

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Categoría: Corto Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Reportos			7,799,068,014	100.00%
IM	BPAG28	210812	AAA(mex)	181,400,315	2.33%
IM	BPAG28	211111	AAA(mex)	400,047,777	5.13%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	1,633,190,172	20.94%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	438,485,794	5.62%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	433,433,868	5.56%
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	985,743,944	12.64%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	579,753,020	7.43%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	299,705,658	3.84%
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	187,285,307	2.40%
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	11,567,939	0.15%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	2,300,274,664	29.49%
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	348,179,557	4.46%
	TOTAL CARTERA			7,799,068,014	100.00%
	ACTIVO NETO			7,785,251,976	
	Cartera al:	30/09/2020			

Límite Máximo de VaR: 0.03%

Var Promedio: 0.0002%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.**

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión de Renta Variable
Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			24,226,558	56.04%
1	AC	*	Alta	957,700	2.22%
1	ALFA	A	Alta	1,535,520	3.55%
1	ALPEK	A	Alta	693,000	1.60%
1	ALSEA	*	Alta	527,000	1.22%
1	AMX	L	Alta	3,886,400	8.99%
1	CEMEX	CPO	Alta	1,885,500	4.36%
1	CHDRAUI	B	Alta	605,000	1.40%
1	FEMSA	UBD	Alta	4,236,400	9.80%
1	GFNORTE	O	Alta	1,149,300	2.66%
1	GMEXICO	B	Alta	787,500	1.82%
1	KOF	UBL	Alta	946,995	2.19%
1	LALA	B	Media	1,023,720	2.37%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	1,577,786	3.65%
1	NEMAK	A	Media	1,219,840	2.82%
1	ORBIA	*	Alta	1,084,720	2.51%
1	PE&OLES	*	Alta	821,767	1.90%
1	R	A	Alta	472,410	1.09%
1	SIMEC	B	Media	816,000	1.89%
	Acciones Bancarias			801,990	1.86%
41	BSMX	B	Alta	801,990	1.86%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			6,174,300	14.28%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	6,174,300	14.28%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			4,314,411	9.98%
1ISP	EWV	*	Alta	4,314,411	9.98%
	Reportos			7,710,113	17.84%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	7,710,113	17.84%
	TOTAL CARTERA			43,227,372	100.00%
	ACTIVO NETO			43,495,322	

Cartera al: 30/09/2020
Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.6443%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión de Renta Variable
Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Extranjeras de Emisiones Extranjeras			201,441	0.05%
1E	SAN	*	Media	201,441	0.05%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			8,326,104	2.18%
1ASP	BAC	*	Alta	1,757,480	0.46%
1ASP	C	*	Alta	1,522,028	0.40%
1ASP	GS	*	Alta	1,732,748	0.45%
1ASP	JPM	*	Alta	1,702,631	0.45%
1ASP	WFC	*	Alta	1,611,217	0.42%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			339,321,005	88.67%
1ISP	ACWX	*	Alta	17,510,019	4.58%
1ISP	DXJ	*	Alta	8,666,140	2.27%
1ISP	EEM	*	Alta	50,490,479	13.19%
1ISP	EUFN	*	Alta	15,430,858	4.03%
1ISP	EWC	*	Alta	3,029,833	0.79%
1ISP	EWI	*	Alta	9,162,674	2.39%
1ISP	EWJ	*	Alta	8,488,285	2.22%
1ISP	EWP	*	Alta	7,071,570	1.85%
1ISP	EZU	*	Alta	11,736,430	3.07%
1ISP	FXI	*	Alta	16,713,270	4.37%
1ISP	HEDJ	*	Alta	38,223,868	9.99%
1ISP	HEWJ	*	Alta	8,476,016	2.22%
1ISP	IBTA	N	Alta	9,571,663	2.50%
1ISP	IVV	*	Alta	31,946,620	8.35%
1ISP	MCHI	*	Alta	5,247,082	1.37%
1ISP	QQQ	*	Alta	15,355,870	4.01%
1ISP	SHV	*	Alta	67,300,757	17.59%
1ISP	XLF	*	Alta	14,899,571	3.89%
	Reportos			34,828,025	9.10%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	34,828,025	9.10%
	TOTAL CARTERA			382,676,574	100.00%
	ACTIVO NETO			367,240,178	

Cartera al: 30/09/2020
Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.3393%
Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.
Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.
El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.
***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."**
Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Fitch México, S.A. de C.V.
Categoría: Discrecional Deuda

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				59,092,368	7.08%
94	BANORTE	19	mxAAA	15,072,161	1.81%
94	BINBUR	18	mxAAA	14,052,625	1.68%
94	BSMX	19	AAA(mex)	14,992,889	1.80%
94	SCOTIAB	19-2	AAA(mex)	14,974,693	1.79%
Certificados Bursátiles Corporativos				141,579,215	16.96%
91	ACBE	17-2	AAA(mex)	10,402,885	1.25%
91	ALSEA	17	A-(mex)	11,910,594	1.43%
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	10,030,338	1.20%
91	DONDE	17	AA/M	10,056,785	1.21%
91	GAP	19	mxAAA	14,851,835	1.78%
91	GMXT	17-2	AAA(mex)	21,000,889	2.52%
91	KOF	17-2	mxAAA	8,038,562	0.96%
91	LALA	18-2	HR AA-	19,952,442	2.39%
91	LIVEPOL	17-2	AAA(mex)	10,009,689	1.20%
91	MERCFCB	18	mxAA+	2,268,527	0.27%
91	TIPCB	17	AAA(mex)	7,986,662	0.96%
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	15,070,010	1.81%
Certificados De La Tesorería De La Federación				366,716,179	43.94%
BI	CETES	201008	AAA(mex)	129,892,386	15.56%
BI	CETES	201105	AAA(mex)	39,834,996	4.77%
BI	CETES	201203	AAA(mex)	69,479,599	8.33%
BI	CETES	210128	AAA(mex)	49,297,670	5.91%
BI	CETES	210826	AAA(mex)	78,211,528	9.37%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				0	0.00%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				34,744,250	4.16%
1ISP	FRMXNX	N	NO APLICA	26,246,250	3.15%
1ISP	IB1MXX	N	NO APLICA	8,498,000	1.02%
Udibonos				118,207,235	14.16%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	92,912,726	11.13%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	25,294,509	3.03%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				32,249,966	3.86%
95	FEFA	19V	mxAAA	14,941,080	1.79%
95	IFCOTCB	17	AAA(mex)	306,418	0.04%
95	PEMEX	14	A(mex)	17,002,468	2.04%
Reportos				82,004,806	9.83%
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	82,004,806	9.83%
TOTAL CARTERA				834,594,019	100.00%
ACTIVO NETO				832,895,000	
Cartera al:		30/09/2020			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.0174%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Fitch México, S.A. de C.V.
Categoría: Discrecional en Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			526,653,103	64.96%
BI	CETES	201119	AAA(mex)	59,654,106	7.36%
BI	CETES	201203	AAA(mex)	54,591,114	6.73%
BI	CETES	201224	AAA(mex)	69,307,847	8.55%
BI	CETES	210128	AAA(mex)	73,946,505	9.12%
BI	CETES	210225	AAA(mex)	68,792,122	8.49%
BI	CETES	210325	AAA(mex)	102,850,220	12.69%
BI	CETES	210729	AAA(mex)	19,299,662	2.38%
BI	CETES	210826	AAA(mex)	78,211,528	9.65%
	Udibonos			96,552,973	11.91%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	23,813,690	2.94%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	10,888,311	1.34%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	50,659,499	6.25%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	11,191,473	1.38%
	Reportos			187,502,502	23.13%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	187,502,502	23.13%
	TOTAL CARTERA			810,708,578	100.00%
	ACTIVO NETO			810,225,514	
	Cartera al:	30/09/2020			

Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.0290%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Fitch México, S.A. de C.V.
Categoría: Discrecional Deuda

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados De La Tesorería De La Federación				466,805,421	20.84%
BI	CETES	201008	AAA(mex)	29,975,166	1.34%
BI	CETES	201203	AAA(mex)	19,851,314	0.89%
BI	CETES	201224	AAA(mex)	148,516,815	6.63%
BI	CETES	210128	AAA(mex)	39,438,136	1.76%
BI	CETES	210225	AAA(mex)	88,447,014	3.95%
BI	CETES	210325	AAA(mex)	44,078,666	1.97%
BI	CETES	210729	AAA(mex)	96,498,310	4.31%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				352,493,331	15.74%
51	+TASA	FF	AAA/1	352,493,331	15.74%
Udibonos				10,545,474	0.47%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	10,545,474	0.47%
Reportos				1,410,228,999	62.96%
IQ	BPAG91	201224	AAA(mex)	923,668,607	41.23%
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	486,560,393	21.72%
TOTAL CARTERA				2,240,073,226	100.00%
ACTIVO NETO				2,237,948,516	

Cartera al: 30/09/2020
Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0010%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."

Límite autorizado por CNBV

La tenencia indirecta en Fondos de Inversión o mecanismos de inversión colectiva que en lo individual representan más del 10% de la composición de la Cartera, se podrán consultar en la siguiente ruta:

51 +TASA <https://www.intercam.com.mx/a.php?archivo=/Fondos/administracion/carteras/INTERCAM.pdf>



+TASAUS

AAAf/S5(mex)

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)			224,162,519	10.10%
FSP	NAFIN	210115	F1+(mex)	224,162,519	10.10%
	Chequera Dolares			1,996,459,724	89.91%
CHD	40-012	6539459	N/A	1,996,459,724	89.91%
	TOTAL CARTERA			2,220,622,243	100.00%
	ACTIVO NETO			2,219,420,694	
	Cartera al:	30/09/2020			

Límite Máximo de VaR: 2.50%

Var Promedio: 1.1620%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV