

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			8,589,763,897	100.00%
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	400,047,179	4.66%
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	891,625,818	10.38%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	428,704,562	4.99%
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	685,726,951	7.98%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	693,947,268	8.08%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	300,347,900	3.50%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	14,371,195	0.17%
IS	BPA182	260903	AAA(mex)	2,293,301,633	26.70%
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	398,801,481	4.64%
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	75,639,367	0.88%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	2,407,250,543	28.03%
	TOTAL CARTERA			8,589,763,897	100.00%
	ACTIVO NETO			8,577,955,073	
	Cartera al:	15/10/2020			

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			24,154,115	54.60%
1	AC	*	Alta	937,000	2.12%
1	ALFA	A	Alta	1,597,120	3.61%
1	ALPEK	A	Alta	702,000	1.59%
1	ALSEA	*	Alta	559,500	1.27%
1	AMX	L	Alta	3,819,200	8.63%
1	CEMEX	CPO	Alta	1,973,250	4.46%
1	CHDRAUI	B	Alta	644,250	1.46%
1	FEMSA	UBD	Alta	4,194,580	9.48%
1	GFNORTE	O	Alta	1,332,000	3.01%
1	GMEXICO	B	Alta	819,980	1.85%
1	KOF	UBL	Alta	913,080	2.06%
1	LALA	B	Media	968,240	2.19%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	1,610,918	3.64%
1	NEMAK	A	Media	1,273,208	2.88%
1	ORBIA	*	Alta	1,082,480	2.45%
1	PE&OLES	*	Alta	834,509	1.89%
1	SIMEC	B	Media	892,800	2.02%
	Acciones Bancarias			458,400	1.04%
41	BSMX	B	Alta	458,400	1.04%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			6,286,500	14.21%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	6,286,500	14.21%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			4,386,473	9.92%
1ISP	EWV	*	Alta	4,386,473	9.92%
	Reportos			8,953,197	20.24%
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	8,953,197	20.24%
	TOTAL CARTERA			44,238,684	100.00%
	ACTIVO NETO			44,258,894	
	Cartera al:		15/10/2020		

Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.5934%

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			205,567	0.06%
1E	SAN	*	Media	205,567	0.06%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			8,170,147	2.23%
1ASP	BAC	*	Alta	1,699,097	0.46%
1ASP	C	*	Alta	1,484,835	0.41%
1ASP	GS	*	Alta	1,734,467	0.47%
1ASP	JPM	*	Alta	1,734,936	0.47%
1ASP	WFC	*	Alta	1,516,811	0.42%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			333,247,633	91.09%
1ISP	ACWX	*	Alta	17,224,087	4.71%
1ISP	DXJ	*	Alta	8,340,384	2.28%
1ISP	EEM	*	Alta	50,138,670	13.71%
1ISP	EUFN	*	Alta	14,902,851	4.07%
1ISP	EWC	*	Alta	3,013,582	0.82%
1ISP	EWI	*	Alta	8,868,907	2.42%
1ISP	EWJ	*	Alta	8,178,992	2.24%
1ISP	EWP	*	Alta	6,979,507	1.91%
1ISP	EZU	*	Alta	11,575,054	3.16%
1ISP	FXI	*	Alta	16,674,372	4.56%
1ISP	HEDJ	*	Alta	37,471,179	10.24%
1ISP	HEWJ	*	Alta	8,161,296	2.23%
1ISP	IBTA	N	Alta	9,230,707	2.52%
1ISP	IVV	*	Alta	31,972,922	8.74%
1ISP	MCHI	*	Alta	5,249,155	1.44%
1ISP	QQQ	*	Alta	15,462,330	4.23%
1ISP	SHV	*	Alta	64,897,547	17.74%
1ISP	XLF	*	Alta	14,906,091	4.08%
	Reportos			24,211,684	6.62%
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	24,211,684	6.62%
	TOTAL CARTERA			365,835,032	100.00%
	ACTIVO NETO			365,792,375	
	Cartera al:		15/10/2020		

Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.3030%

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			59,055,573	7.01%
94	BANORTE	19	mxAAA	15,044,034	1.79%
94	BINBUR	18	mxAAA	14,026,083	1.66%
94	BSMX	19	AAA(mex)	15,027,025	1.78%
94	SCOTIAB	19-2	AAA(mex)	14,958,431	1.78%
	Certificados Bursátiles Corporativos			141,598,784	16.80%
91	ACBE	17-2	AAA(mex)	10,383,452	1.23%
91	ALSEA	17	A-(mex)	11,939,642	1.42%
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	10,011,227	1.19%
91	DONDE	17	AA/M	10,031,282	1.19%
91	GAP	19	mxAAA	14,824,477	1.76%
91	GMXT	17-2	AAA(mex)	21,042,596	2.50%
91	KOF	17-2	mxAAA	8,054,038	0.96%
91	LALA	18-2	HR AA-	19,952,654	2.37%
91	LIVEPOL	17-2	AAA(mex)	10,029,892	1.19%
91	MERCFCB	18	mxAA+	2,274,948	0.27%
91	TIPCB	17	AAA(mex)	8,007,921	0.95%
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	15,046,656	1.79%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			375,737,482	44.58%
BI	CETES	201105	AAA(mex)	99,769,910	11.84%
BI	CETES	201203	AAA(mex)	69,607,412	8.26%
BI	CETES	210107	AAA(mex)	59,416,650	7.05%
BI	CETES	210128	AAA(mex)	49,389,340	5.86%
BI	CETES	210826	AAA(mex)	78,347,870	9.30%
BI	CETES	210923	AAA(mex)	19,206,300	2.28%
	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)			34,838,400	4.13%
1ISP	FRMXNX	N	Alta	26,325,000	3.12%
1ISP	IB1MXX	N	Alta	8,513,400	1.01%
	Udibonos			118,339,249	14.04%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	92,965,682	11.03%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	25,373,566	3.01%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			32,040,383	3.80%
95	FEFA	19V	mxAAA	14,999,865	1.78%
95	PEMEX	14	A(mex)	17,040,518	2.02%
	Reportos			81,233,218	9.64%
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	81,233,218	9.64%
	TOTAL CARTERA			842,843,089	100.00%
	ACTIVO NETO			840,869,023	
	Cartera al:		15/10/2020		

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.0171%
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				566,003,455	68.89%
BI	CETES	201119	AAA(mex)	59,761,392	7.27%
BI	CETES	201203	AAA(mex)	54,691,538	6.66%
BI	CETES	201224	AAA(mex)	69,434,400	8.45%
BI	CETES	210128	AAA(mex)	74,084,010	9.02%
BI	CETES	210225	AAA(mex)	68,915,987	8.39%
BI	CETES	210325	AAA(mex)	103,022,178	12.54%
BI	CETES	210729	AAA(mex)	19,333,480	2.35%
BI	CETES	210826	AAA(mex)	78,347,870	9.54%
BI	CETES	210923	AAA(mex)	38,412,600	4.68%
Udibonos				96,711,354	11.77%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	23,827,263	2.90%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	10,898,818	1.33%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	50,817,834	6.19%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	11,167,438	1.36%
Reportos				158,935,443	19.34%
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	158,935,443	19.34%
TOTAL CARTERA				821,650,252	100.00%
ACTIVO NETO				852,614,635	
Cartera al:		15/10/2020			

Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.0282%

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				672,803,197	27.78%
BI	CETES	201105	AAA(mex)	69,838,937	2.88%
BI	CETES	201203	AAA(mex)	19,887,832	0.82%
BI	CETES	201224	AAA(mex)	148,788,000	6.14%
BI	CETES	210107	AAA(mex)	69,319,425	2.86%
BI	CETES	210128	AAA(mex)	39,511,472	1.63%
BI	CETES	210225	AAA(mex)	88,606,269	3.66%
BI	CETES	210325	AAA(mex)	44,152,362	1.82%
BI	CETES	210729	AAA(mex)	96,667,400	3.99%
BI	CETES	210923	AAA(mex)	96,031,500	3.96%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				353,096,522	14.58%
51	+TASA	FF	AAA/1	353,096,522	14.58%
Udibonos				10,551,485	0.44%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	10,551,485	0.44%
Reportos				1,385,862,045	57.21%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	632,663,139	26.12%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	753,198,906	31.09%
TOTAL CARTERA				2,422,313,249	100.00%
ACTIVO NETO				2,420,970,923	

Cartera al: 15/10/2020
Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0011%

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)			216,353,275	9.74%
FSP	NAFIN	210115	F1+(mex)	216,353,275	9.74%
	Chequera Dolares			2,004,670,733	90.26%
CHD	40-012	6539459	N/A	2,004,670,733	90.26%
	TOTAL CARTERA			2,221,024,008	100.00%
	ACTIVO NETO			2,219,889,014	
	Cartera al:	15/10/2020			

Límite Máximo de VaR: 2.50%

Var Promedio: 1.1690%

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