

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			6,959,305,560	100.00%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	233,494,179	3.36%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	500,944,556	7.20%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	3,400,662,027	48.87%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	1,200,231,633	17.25%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	558,246,571	8.02%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	465,793,197	6.69%
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	167,987,228	2.41%
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	131,887,779	1.90%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	300,058,391	4.31%
	TOTAL CARTERA			6,959,305,560	100.00%
	ACTIVO NETO			6,952,815,174	

Cartera al: **23/06/2022**

Límite Máximo de VaR: 0.03%

Var Promedio: 0.0004%

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			91,796,242	64.48%
1	AC	*	Alta	5,470,500	3.84%
1	ALFA	A	Alta	4,369,200	3.07%
1	ALPEK	A	Alta	1,385,420	0.97%
1	ALSEA	*	Alta	1,891,827	1.33%
1	AMX	L	Alta	15,794,100	11.10%
1	BACHOCO	B	Media	7,214,000	5.07%
1	CEMEX	CPO	Alta	15,391,950	10.81%
1	FEMSA	UBD	Alta	16,191,600	11.37%
1	KIMBER	A	Alta	3,925,150	2.76%
1	KOF	UBL	Alta	2,217,345	1.56%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	4,517,000	3.17%
1	NEMAK	A	Alta	6,240,000	4.38%
1	ORBIA	*	Alta	792,200	0.56%
1	PE&OLES	*	Alta	2,626,540	1.85%
1	WALMEX	*	Alta	3,769,410	2.65%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			16,956,000	11.91%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	16,956,000	11.91%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			18,278,010	12.84%
1ISP	EWV	*	Alta	18,278,010	12.84%
	Reportos			15,325,007	10.77%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	15,325,007	10.77%
	TOTAL CARTERA			142,355,259	100.00%
	ACTIVO NETO			137,762,477	

Cartera al: 23/06/2022
Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.2708%
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 Referidas a los Titulos Referenciados a Acciones			4,210,000	0.96%
1B	GENIUS	21	Media	4,210,000	0.96%
	Acciones Extranjeras de Emisiones Extranjeras			299,871	0.07%
1E	SAN	*	Baja	299,871	0.07%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			9,418,276	2.15%
1ASP	BABA	N	Alta	9,418,276	2.15%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			405,272,395	92.62%
1ISP	ACWI	*	Alta	42,387,222	9.69%
1ISP	ACWX	*	Alta	38,041,344	8.69%
1ISP	DXJ	*	Alta	5,026,153	1.15%
1ISP	EEM	*	Alta	36,934,362	8.44%
1ISP	EUFN	*	Alta	16,003,760	3.66%
1ISP	EWC	*	Alta	3,306,364	0.76%
1ISP	EWI	*	Alta	8,310,514	1.90%
1ISP	EWJ	*	Alta	20,013,001	4.57%
1ISP	EWP	*	Alta	6,862,715	1.57%
1ISP	EZU	*	Alta	28,023,382	6.40%
1ISP	FXI	*	Alta	12,518,577	2.86%
1ISP	GDX	*	Alta	8,673,954	1.98%
1ISP	GLD	*	Alta	18,730,660	4.28%
1ISP	HEDJ	*	Alta	23,372,071	5.34%
1ISP	IVV	*	Alta	52,463,710	11.99%
1ISP	MCHI	*	Alta	19,553,751	4.47%
1ISP	QQQ	*	Alta	14,244,067	3.26%
1ISP	SHV	*	Alta	17,613,137	4.03%
1ISP	XLE	*	Alta	7,066,777	1.62%
1ISP	XLF	*	Alta	21,835,402	4.99%
1ISP	XLI	*	Alta	4,291,472	0.98%
	Reportos			18,361,551	4.20%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	18,361,551	4.20%
	TOTAL CARTERA			437,562,093	100.00%
	ACTIVO NETO			432,020,114	
	Cartera al:		23/06/2022		

Límite Máximo de VaR: 7.00%

Var Promedio: 1.2754%

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				39,877,859	5.78%
94	BINBUR	18	mxAAA	14,107,550	2.05%
94	BLADEX	21	AAA (mex)	10,739,720	1.56%
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	15,030,589	2.18%
Certificados Bursátiles Corporativos				170,024,522	24.65%
91	ACBE	17-2	AAA (mex)	10,388,094	1.51%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,115,496	2.19%
91	BACHOCO	17	AAA (mex)	10,014,374	1.45%
91	DONDE	20	AA/M	9,921,039	1.44%
91	GAP	19	mxAAA	15,094,874	2.19%
91	GMXT	17-2	AAA (mex)	21,079,259	3.06%
91	KOF	17-2	mxAAA	8,046,418	1.17%
91	LIVEPOL	17-2	AAA (mex)	10,058,176	1.46%
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	9,850,501	1.43%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,102,652	2.19%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,067,117	2.19%
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	15,080,039	2.19%
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	15,206,484	2.21%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				3,916,448	0.57%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
93	TOYOTA	01921	F1+ (mex)	3,916,448	0.57%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				37,701,688	5.47%
1ISP	FRMXNX	N	Alta	28,446,750	4.13%
1ISP	IB1MXX	N	Alta	9,254,938	1.34%
Udibonos				24,719,314	3.58%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	24,719,314	3.58%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				15,067,720	2.19%
95	FEFA	19V	mxAAA	15,067,720	2.19%
Certificados De La Tesorería De La Federación				257,601,422	37.35%
BI	CETES	220630	AAA(mex)	59,924,148	8.69%
BI	CETES	220714	AAA(mex)	39,828,516	5.78%
BI	CETES	221117	AAA(mex)	43,475,958	6.30%
BI	CETES	221215	AAA(mex)	47,960,245	6.95%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	38,078,884	5.52%
BI	CETES	230209	AAA(mex)	28,333,671	4.11%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				57,965,690	8.41%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	44,600,510	6.47%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	13,365,179	1.94%
Reportos				82,755,583	12.00%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	64,408,586	9.34%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	18,346,997	2.66%
TOTAL CARTERA				689,630,246	100.00%
ACTIVO NETO				689,439,904	
Cartera al:		23/06/2022			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.1130%
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	%
	Udibonos			54,758,299	22.11%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	10,610,797	4.28%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	33,213,616	13.41%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,933,886	4.42%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			48,692,125	19.66%
BI	CETES	220714	AAA(mex)	24,892,823	10.05%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	23,799,303	9.61%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			31,998,715	12.92%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	18,633,536	7.52%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	13,365,179	5.40%
	Reportos			112,223,861	45.31%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	112,223,861	45.31%
	TOTAL CARTERA			247,673,000	100.00%
	ACTIVO NETO			245,871,786	
	Cartera al:	23/06/2022			

Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.2890%
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: Corto Plazo

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,086,998,010	22.18%
BI	CETES	220630	AAA(mex)	34,955,753	0.71%
BI	CETES	220714	AAA(mex)	69,691,937	1.42%
BI	CETES	220825	AAA(mex)	295,870,620	6.04%
BI	CETES	220908	AAA(mex)	98,300,390	2.01%
BI	CETES	221006	AAA(mex)	68,368,769	1.40%
BI	CETES	221117	AAA(mex)	357,468,988	7.30%
BI	CETES	221215	AAA(mex)	67,144,343	1.37%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	95,197,210	1.94%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			50,143,262	1.02%
LD	BONDESD	220707	AAA(mex)	50,143,262	1.02%
	Reportos			3,762,674,006	76.79%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	295,106,033	6.02%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	1,495,733,738	30.53%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	1,971,834,235	40.24%
	TOTAL CARTERA			4,899,815,278	100.00%
	ACTIVO NETO			4,896,125,724	

Cartera al: 23/06/2022
Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0070%

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: Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				1,261,239,969	46.79%
FSP	BACMEXT	D22004	F1+ (mex)	140,219,883	5.20%
FSP	BACMEXT	D22005	F1+ (mex)	140,096,367	5.20%
FSP	NAFIN	D22011	F1+ (mex)	140,198,650	5.20%
FSP	NAFIN	D22012	F1+ (mex)	140,182,380	5.20%
FSP	NAFIN	D22013	F1+ (mex)	140,159,035	5.20%
FSP	NAFIN	D22014	F1+ (mex)	140,159,028	5.20%
FSP	NAFIN	D22015	F1+ (mex)	140,129,606	5.20%
FSP	NAFIN	D22017	F1+ (mex)	140,071,606	5.20%
FSP	NAFIN	D22018	F1+ (mex)	140,023,415	5.19%
Chequera Dolares				1,434,508,737	53.21%
CHD	40-002	9409199	N/A	400,044,000	14.84%
CHD	40-012	6539459	N/A	634,334,848	23.53%
CHD	40-044	0941285	N/A	400,129,889	14.84%
TOTAL CARTERA				2,695,748,706	100.00%
ACTIVO NETO				2,694,637,562	
Cartera al:		23/06/2022			

Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.1212%
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