

# NTEDP

AAAf/S4(mex)

Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Mediano Plazo

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Cert. Burs. de Banca de Desarr</b>			<b>55,595,831</b>	<b>0.73%</b>
CD	NAFR	17S	AAA (mex)	55,595,831	0.73%
	<b>Certificados de Deposito</b>			<b>230,681,128</b>	<b>3.01%</b>
F	BANORTE	20024	F1+ (mex)	100,353,111	1.31%
F	BSCTIA	21002	F1+ (mex)	80,189,408	1.05%
F	BSCTIA	20022	F1+ (mex)	50,138,609	0.65%
	<b>Cert. Bursatiles Bancarios</b>			<b>2,117,321,492</b>	<b>27.61%</b>
94	BLADEX	19	AAA (mex)	228,464,276	2.98%
94	HSBC	19-2	AAA (mex)	170,365,755	2.22%
94	BSMX	19	AAA (mex)	150,200,514	1.96%
94	BACOMER	18V	AAA (mex)	150,129,347	1.96%
94	BACOMER	17-2	AAA (mex)	136,355,639	1.78%
94	BSMX	18	AAA (mex)	126,622,561	1.65%
94	BINBUR	18	mxAAA	120,593,089	1.57%
94	BACTIN	19-2	HR AA-	120,195,004	1.57%
94	SCOTIAB	18	AAA (mex)	115,177,103	1.50%
94	SCOTIAB	19	AAA (mex)	110,350,532	1.44%
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	110,250,870	1.44%
94	BANORTE	19	mxAAA	100,358,721	1.31%
94	BACOMER	19	AAA (mex)	82,626,868	1.08%
94	BACTIN	19	HR AA-	80,188,470	1.05%
94	SCOTIAB	17-2	AAA (mex)	75,343,433	0.98%
94	BLADEX	20	AAA (mex)	55,056,454	0.72%
94	BACOMER	20	AAA (mex)	54,951,647	0.72%
94	BANORTE	19-2	mxAAA	50,244,807	0.66%
94	COMPART	19	AA (mex)	44,873,375	0.59%
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	34,973,027	0.46%
	<b>Certificados Bursatiles Corps.</b>			<b>2,494,137,911</b>	<b>32.52%</b>
91	SORIANA	20	AA+ (mex)	150,532,107	1.96%
91	BACHOCO	17	AAA (mex)	130,335,855	1.70%
91	LIVEPOL	17-2	AAA (mex)	130,155,523	1.70%
91	NRF	19	Aa3.mx	120,212,716	1.57%
91	GAP	20	mxAAA	118,953,780	1.55%
91	FUNO	17-2	AAA (mex)	113,885,991	1.49%
91	GRUMA	18	mxAAA+	106,130,446	1.38%
91	GMXT	17-2	AAA (mex)	101,514,137	1.32%
91	NM	21	mxAAA+	100,266,769	1.31%
91	GCARSO	20	AAA (mex)	100,029,675	1.30%
91	GMXT	19-2	AAA (mex)	98,934,537	1.29%
91	GPH	19	AAA (mex)	90,654,833	1.18%
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	85,478,511	1.11%
91	LALA	18-2	HR AA-	84,830,978	1.11%
91	ACBE	17-2	AAA (mex)	83,090,730	1.08%
91	CETEMEM	19	AAA (mex)	80,363,204	1.05%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	80,233,553	1.05%
91	GAP	19	mxAAA	80,166,429	1.05%
91	ACBE	21V	AAA (mex)	80,010,751	1.04%
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	70,424,274	0.92%
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	70,055,691	0.91%
91	GAP	17	mxAAA	50,120,376	0.65%
91	KOF	17-2	mxAAA	46,292,080	0.60%
91	FUNO	18	AAA (mex)	45,518,931	0.59%
91	ARRENCB	21	mxAAA	45,228,047	0.59%
91	PCARFM	17	AAA (mex)	41,654,385	0.54%

**NTEDP**

AAAf/S4(mex)

**Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda**

Fitch México, S.A. de C.V.

**Mediano Plazo**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
91	GAP	17-2	mxAAA	40,094,012	0.52%
91	KOF	20-2	AAA (mex)	26,568,841	0.35%
91	ACTINVR	19-2	AA- (mex)	24,048,996	0.31%
91	LALA	20-2	HR AA-	20,049,180	0.26%
91	TOYOTA	17-4	AAA (mex)	16,697,260	0.22%
91	CRELCB	19	AAA (mex)	14,999,402	0.20%
91	ABCCB	18	mxAAA	14,309,241	0.19%
91	ACTINVR	19	AA- (mex)	10,050,442	0.13%
91	VWLEASE	18	mxAAA	10,015,496	0.13%
91	FUTILCB	19	mxAAA	8,030,110	0.11%
91	CREALCB	17	AAA (mex)	4,200,622	0.06%
<b>Cert. Burs. Ref. a Pap. Com.</b>				<b>131,766,308</b>	<b>1.72%</b>
93	CHDRAUI	01720	F1+ (mex)	90,341,455	1.18%
93	CETELEM	00421	F1+ (mex)	25,094,654	0.33%
93	CETELEM	00321	F1+ (mex)	16,330,199	0.21%
<b>Pagare con Rend. Liq. Venc.</b>				<b>500,064,443</b>	<b>6.52%</b>
I	NAFIN	21353	F1+ (mex)	500,064,443	6.52%
<b>Tit. de Org. Multilat. Financ.</b>				<b>465,525,511</b>	<b>6.07%</b>
JI	CABEI	1-19	mxAAA	100,572,782	1.31%
JI	BIDINV	1-20	mxAAA	100,190,062	1.31%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	95,395,334	1.24%
JI	BIDINV	1-21G	mxAAA	85,198,928	1.11%
JI	CABEI	2-19	mxAAA	55,378,406	0.72%
JI	CABEI	1-20	mxAAA	28,789,999	0.38%
<b>Cert.Burs.Emit.Ent. o Inst.GF.</b>				<b>594,621,382</b>	<b>7.75%</b>
95	FEFA	18V	mxAAA	125,149,752	1.63%
95	FNCOT	19	AAA (mex)	100,183,691	1.31%
95	FEFA	19V	mxAAA	100,111,926	1.31%
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	80,173,933	1.05%
95	FEFA	20G	mxAAA	50,175,244	0.65%
95	FEFA	19-2	mxAAA	50,163,002	0.65%
95	FEFA	20-3	mxAAA	50,096,491	0.65%
95	FEFA	19-3	mxAAA	25,165,017	0.33%
95	FEFA	17-5	mxAAA	13,402,326	0.18%
<b>Reportos</b>				<b>1,080,430,464</b>	<b>14.09%</b>
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	580,365,237	7.57%
CD	BANOB	21-2X	AAA (mex)	250,032,619	3.26%
CD	SHF	21	AAA (mex)	250,032,608	3.26%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>7,670,144,470</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>7,664,498,215</b>	

Cartera al: 31/Ago/2021

Límite Máximo de VaR: 0.35%

Var Promedio: 0.1072%

Parametros: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 500 observaciones.

Límite autorizado por CNBV

Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Valores Respaldados por Activos.</b>					
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	85,478,511	1.11%
91	ARRENCB	21	mxAAA	45,228,047	0.59%

91	CRELCB	19	AAA (mex)	14,999,402	0.20%
91	ABCCB	18	mxAAA	14,309,241	0.19%
91	FUTILCB	19	mxAAA	8,030,110	0.11%
91	CREALCB	17	AAA (mex)	4,200,622	0.06%
<b>Total:</b>				<b>172,245,933</b>	<b>2.25%</b>

"El riesgo en los instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos(en caso de tenerlos en el fondo) consiste en movimientos adversos en los factores de riesgo que afecten instrumento adquirido El riesgo se considera alto debido a la existencia de factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación, etc"