

NTEEURO

AAAf/S5(mex)

Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Euros			124,492,471	99.74%
CHE	40-012	2742284	N/A	124,492,471	99.74%
	Chequera en Pesos			15,000	0.01%
CHM	40-012	2742136	N/A	15,000	0.01%
	Reportos			303,990	0.24%
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	303,990	0.24%
	TOTAL CARTERA			124,811,461	100.00%
	ACTIVO NETO			124,592,061	
	Cartera al:		31/Ago/2021		

Límite Máximo de VaR: 2.58%

Var Promedio: 1.7239%

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.