

NTEMP+

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	%
	Bonos Prot. Ahorro pago Sem.			322,558,610	10.78%
IS	BPA182	210909	AAA(mex)	61,602,078	2.06%
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	51,609,226	1.72%
IS	BPA182	220908	AAA(mex)	51,462,232	1.72%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	35,807,553	1.20%
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	30,931,972	1.03%
IS	BPA182	220310	AAA(mex)	20,670,185	0.69%
IS	BPA182	251002	AAA(mex)	20,255,277	0.68%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	20,207,921	0.68%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	19,977,764	0.67%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	10,034,402	0.34%
	Bonos De Des. Del Gob. Fed.			565,283,345	18.89%
LD	BONDESD	231221	AAA(mex)	60,176,152	2.01%
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	59,691,268	1.99%
LD	BONDESD	230831	AAA(mex)	50,372,401	1.68%
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	40,934,366	1.37%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	39,905,523	1.33%
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	39,895,500	1.33%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	39,846,521	1.33%
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	39,845,718	1.33%
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	39,732,880	1.33%
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	29,931,813	1.00%
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	25,370,324	0.85%
LD	BONDESD	231207	AAA(mex)	19,965,306	0.67%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	19,962,116	0.67%
LD	BONDESD	260212	AAA(mex)	19,900,808	0.67%
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	19,893,929	0.67%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	19,858,720	0.66%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			461,260,466	15.41%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	460,976,962	15.40%
M	BONOS	211209	AAA(mex)	283,504	0.01%
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			145,919,153	4.88%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	20,097,404	0.67%
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	20,040,494	0.67%
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	20,033,821	0.67%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	20,008,352	0.67%
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	19,977,737	0.67%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	19,965,887	0.67%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	18,093,003	0.60%
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	7,702,455	0.26%
	Bonos Prot. Ahorro pago Mensual			140,124,854	4.68%
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	60,082,349	2.01%
IM	BPAG28	220512	AAA(mex)	30,073,957	1.01%
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	20,013,870	0.67%
IM	BPAG28	231109	AAA(mex)	19,960,701	0.67%
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	9,993,977	0.33%
	Cert. Burs. de Banca de Desarr			60,110,765	2.01%
CD	BACMEXT	21	mxAAA	30,091,358	1.01%
CD	NAFR	240628	mxAAA	30,019,407	1.00%
	Certificados de Deposito			85,259,422	2.85%
F	BANORTE	20024	F1+ (mex)	50,176,556	1.68%

NTEMP+

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	%
F	BSCTIA	21002	F1+ (mex)	35,082,866	1.17%
	Cert. Bursátiles Bancarios			127,271,121	4.25%
94	BSMX	18	AAA (mex)	55,063,342	1.84%
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	40,091,226	1.34%
94	HSBC	19-2	AAA (mex)	30,064,545	1.00%
94	BANOB	11-2	AAA (mex)	2,052,008	0.07%
	Certificados Bursátiles Corps.			67,876,382	2.27%
91	MONTPIO	17	HR AA+	42,932,581	1.43%
91	SORIANA	20	AA+ (mex)	20,070,948	0.67%
91	ALPHACB	18	HR A+	4,872,853	0.16%
	Certi. De La Tes. De La Fed.			371,637,846	12.42%
BI	CETES	220602	AAA(mex)	86,555,168	2.89%
BI	CETES	220630	AAA(mex)	67,053,539	2.24%
BI	CETES	220210	AAA(mex)	58,659,276	1.96%
BI	CETES	220331	AAA(mex)	58,249,206	1.95%
BI	CETES	220407	AAA(mex)	33,943,767	1.13%
BI	CETES	220505	AAA(mex)	33,803,837	1.13%
BI	CETES	220728	AAA(mex)	33,373,053	1.12%
	Oblig. Ind. Com. y Serv.			0	0.00%
2	LERMA	90		0	0.00%
	Udibonos			439,774,652	14.69%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	439,774,652	14.69%
	Reportos			206,270,168	6.89%
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	144,389,183	4.82%
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	61,880,985	2.07%
	TOTAL CARTERA			2,993,346,784	100.00%
	ACTIVO NETO			2,989,418,771	

Cartera al: 31/Ago/2021

Límite Máximo de VaR: 0.27%

Var Promedio: 0.0454%

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	%
	Valores Respaldados por Activos.				
91	ALPHACB	18	HR A+	4,872,853	0.16%
Total:				4,872,853	0.16%

"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"