

NTETR

AAAf/S5(mex)

Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Largo Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Certi. De La Tes. De La Fed.			143,825,710	12.88%
BI	CETES	220210	AAA(mex)	24,441,365	2.19%
BI	CETES	220505	AAA(mex)	24,145,598	2.16%
BI	CETES	220630	AAA(mex)	23,947,693	2.15%
BI	CETES	220728	AAA(mex)	23,837,895	2.14%
BI	CETES	220331	AAA(mex)	20,387,222	1.83%
BI	CETES	220407	AAA(mex)	16,486,972	1.48%
BI	CETES	220602	AAA(mex)	10,578,965	0.95%
	Udibonos			948,826,515	84.98%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	416,189,170	37.28%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	376,238,574	33.70%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	156,398,771	14.01%
	Reportos			23,885,145	2.14%
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	23,885,145	2.14%
	TOTAL CARTERA			1,116,537,370	100.00%
	ACTIVO NETO			1,114,478,677	

Cartera al: 31/Ago/2021

Límite Máximo de VaR: 0.68%

Var Promedio: 0.3198%

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.