

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)				2,500,939,855	97.65%
FSP	BACMEXT	D18217	F1+(mex)	191,787,532	7.49%
FSP	BACMEXT	D18218	F1+(mex)	191,792,047	7.49%
FSP	BACMEXT	D18219	F1+(mex)	191,803,357	7.49%
FSP	BACMEXT	D19001	F1+(mex)	191,642,000	7.48%
FSP	BACMEXT	D19002	F1+(mex)	191,449,083	7.48%
FSP	BACMEXT	D19003	F1+(mex)	191,352,827	7.47%
FSP	NAFIN	190201	F1+(mex)	286,974,744	11.21%
FSP	NAFIN	190205	F1+(mex)	191,278,644	7.47%
FSP	NAFIN	190227	F1+(mex)	191,728,856	7.49%
FSP	NAFIN	190313	F1+(mex)	191,539,407	7.48%
FSP	NAFIN	190403	F1+(mex)	191,256,287	7.47%
FSP	NAFIN2	190201	F1+(mex)	298,335,070	11.65%
Chequera Dolares				59,257,043	2.31%
CHD	40-012	6539459	N/A	59,257,043	2.31%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,030,633	0.04%
1ISP	FLOA	N	N/A	1,030,633	0.04%
TOTAL CARTERA				2,561,227,530	100.00%
ACTIVO NETO				2,557,830,294	
Cartera al:		31/Ene/2019			

Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.1173%
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