



+TASAUS

AAAf/S5(mex)

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	%
	Chequera Dolares			2,148,309,450	100.00%
CHD	40-002	9409199	N/A	599,010,000	27.88%
CHD	40-012	6539459	N/A	950,248,997	44.23%
CHD	40-044	0941285	N/A	599,050,453	27.89%
	TOTAL CARTERA			2,148,309,450	100.00%
	ACTIVO NETO			2,148,278,558	

Cartera al: 2/Sep/2021

Límite Máximo de VaR: 2.50%

Var Promedio: 1.2953%

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