



Kapital
Fondos.



Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera

Calificación: **HR AAA/2CP**

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|--|---------|------------|--------------------|----------------|
| | Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot) | | | 267,418,742 | 39.72% |
| 1ISP | SHV | * | Alta | 267,418,742 | 39.72% |
| | Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs) | | | 10,754,965 | 1.60% |
| I | NAFIN | 26052 | F1+ (mex) | 10,754,965 | 1.60% |
| | Chequera Dólares | | | 395,020,310 | 58.68% |
| CHD | 37-006 | 4006562 | N/A | 160,328,219 | 23.82% |
| CHD | 37-135 | 6009236 | N/A | 160,058,460 | 23.78% |
| CHD | 40-128 | 0430031 | N/A | 74,633,631 | 11.09% |
| | TOTAL CARTERA | | | 673,194,017 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 689,371,993 | |

Cartera al: **30/01/2026**

Límite Máximo de VaR: 2.50% **VaR Promedio: 0.9300%**

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