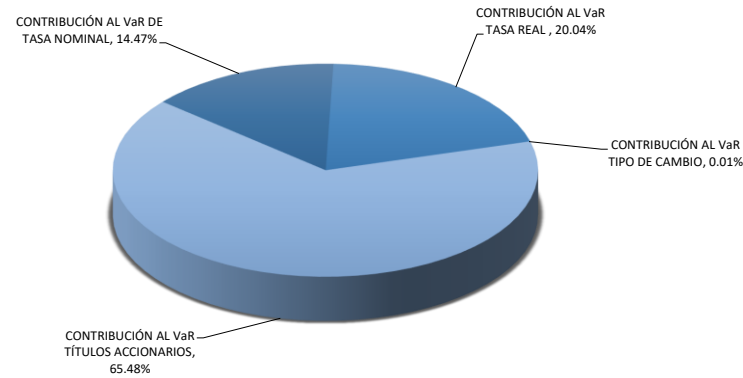


**RIESGO DE MERCADO**

Valor en Riesgo (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR DE TASA NOMINAL</b>	<b>0.079126%</b>
CUPÓN CERO TASA NOMINAL	0.003442%
TASA FIJA TASA NOMINAL	0.075685%
TASA VARIABLE NOMINAL	-0.000002%
SUBYACENTE	0.000000%
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR TASA REAL</b>	<b>0.109553%</b>
CUPÓN CERO TASA REAL	0.000000%
TASA FIJA TASA REAL	0.109553%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.000000%
SUBYACENTE TASA REAL	0.000000%
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR TIPO DE CAMBIO</b>	<b>0.000040%</b>
USD	0.000040%
EUR	0.000000%
JPY	0.000000%
OTROS	0.000000%
SUBYACENTE	0.000000%
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR TÍTULOS ACCIONARIOS</b>	<b>0.358048%</b>
SUBYACENTE	0.000000%
<b>VaR TOTAL*</b>	<b>0.546767%</b>

**Contribución al VaR por factores de riesgo**



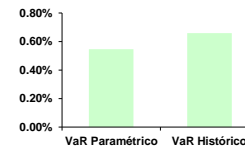
ACTIVO NETO
30/09/2024
53,447,581,106.93

\* VaR Paramétrico con horizonte de tiempo a un día, 252 observaciones y un nivel de confianza del 97.4%  
Porcentajes con respecto al Activo Neto utilizado para la medición del VaR.

VaR HISTÓRICO *	VaR
	0.659312%

\* VaR Histórico con horizonte de tiempo a un día, 1000 observaciones y un nivel de confianza del 97.4%  
Porcentajes con respecto al Activo Neto utilizado para la medición del VaR.

VAR PARAMÉTRICO Vs. HISTÓRICO

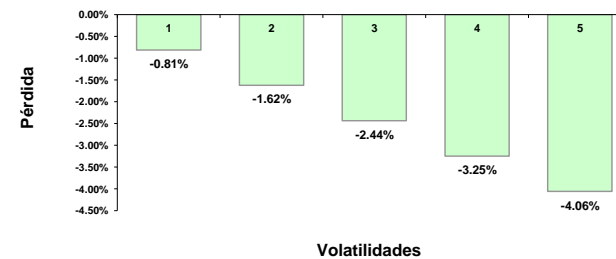


Análisis de Sensibilidad

MOVIMIENTO EN VALOR DE MERCADO POR N VOLATILIDADES *	IMPORTE CON INTERESES STRESS	PÉRDIDA STRESS	PÉRDIDA STRESS PORC
1	54,326,670,114.18	-444,674,854.08	-0.81%
2	53,881,995,260.11	-889,349,708.15	-1.62%
3	53,437,320,406.03	-1,334,024,562.23	-2.44%
4	52,992,645,551.96	-1,778,699,416.30	-3.25%
5	52,547,970,697.88	-2,223,374,270.38	-4.06%

\* El incremento en tasa para estimar las posibles pérdidas, es a partir de la volatilidad de los Factores de Riesgo.

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD



**RIESGO DE CRÉDITO**

Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa

TIPO DE TASA	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO \$	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO*
CUPÓN CERO TASA NOMINAL	559,075.57	0.00%
TASA FIJA TASA NOMINAL	39,259,570.64	0.07%
TASA VARIABLE NOMINAL	29,005,465.83	0.05%
CUPÓN CERO TASA REAL	0.00	0.00%
TASA FIJA TASA REAL	31,849,820.91	0.06%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.00	0.00%
<b>TOTAL</b>	<b>100,673,932.94</b>	<b>0.19%</b>

Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia

NIVEL DE CALIFICACIÓN	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO \$	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO
AAA	34,499,411.20	0.06%
AA	26,758,952.65	0.05%
A	8,621,232.64	0.02%
BBB	30,794,336.45	0.06%
<b>TOTAL</b>	<b>100,673,932.94</b>	<b>0.19%</b>

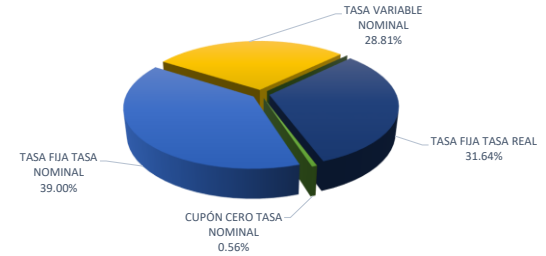
Exposición de Riesgo de Crédito por Plazo

PLAZO AL VENCIMIENTO	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO \$	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO
0-360 días	767,628.17	0.00%
361-720 días	4,341,162.78	0.01%
721-1092 días	19,726,971.10	0.04%
1093-1820 días	16,530,952.63	0.03%
1821-3600 días	14,836,240.33	0.03%
Más de 3600 días	44,470,977.93	0.08%
<b>TOTAL</b>	<b>100,673,932.94</b>	<b>0.19%</b>

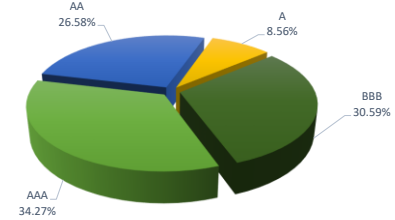
Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

SECTOR	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO \$	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO*
Bonos soberanos México	0.00	0.00%
Bonos soberanos Extranjeros	0.00	0.00%
Materiales, energía e industrial	27,575,952.32	0.05%
Productos de consumo frecuente	2,532,239.24	0.00%
Salud	1,364.75	0.00%
Servicios de telecomunicaciones	5,272,629.69	0.01%
Servicios financieros	19,145,371.07	0.04%
Servicios públicos	3,902,295.09	0.01%
Servicios y bienes de consumo no básico	17,241,754.33	0.03%
Hipotecario-Vivienda	13,914,476.76	0.03%
Fideicomisos Carreteros	11,087,849.68	0.02%
<b>TOTAL</b>	<b>100,673,932.94</b>	<b>0.19%</b>

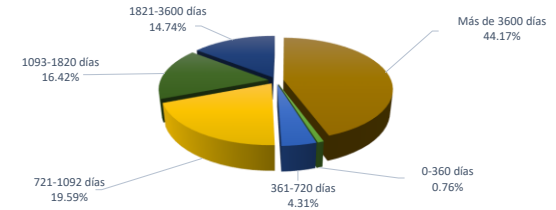
Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa



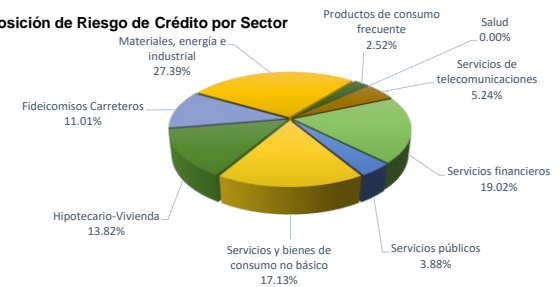
Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia



Exposición de Riesgo de Crédito por Plazo



Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

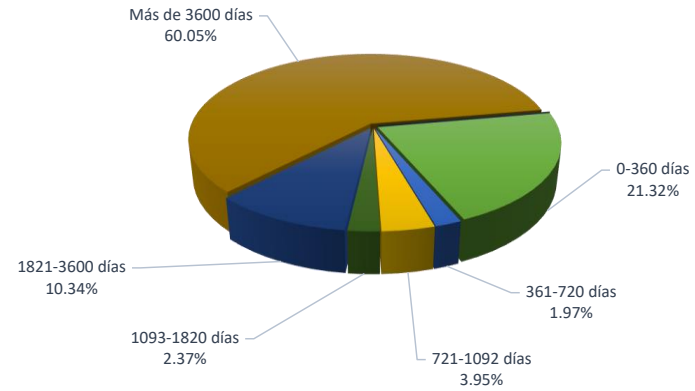


**RIESGO DE LIQUIDEZ**

Desglose por plazo de los vencimientos.

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL
0-360 días	138,367,545.98
361-720 días	12,813,332.84
721-1092 días	25,616,887.73
1093-1820 días	15,403,589.17
1821-3600 días	67,104,566.57
Más de 3600 días	389,728,916.97
<b>TOTAL</b>	<b>649,034,839.26</b>

**Desglose por plazo de los vencimientos**



**RENDIMIENTO**

<b>Cifras al cierre de agosto de 2024</b>
<b>4.78%</b>

**ESTRUCTURA DE COMISIONES**

Comisiones por administración de cuenta individual

<b>COMISIONES VARIABLES</b>	
<b>Conceptos</b>	<b>Comisión</b>
Comisión sobre Saldo	0.566% anual sobre el saldo administrado

<b>COMISIONES POR CUOTA FIJA</b>	
<b>Conceptos</b>	<b>Comisión</b>
Pago de Retiros Programados	Sin comisión
Aportaciones voluntarias	Sin comisión
Estados de cuenta adicionales	Sin comisión
Reposición de documentos	Sin comisión

**INDICADORES DE RIESGO RENDIMIENTO**

<b>ERROR DE SEGUIMIENTO ANUALIZADO</b>	2.65%
----------------------------------------	-------

**PONDERACIÓN POR CLASE DE ACTIVO**

Comparación de las ponderaciones de la Trayectoria de Inversión con respecto a la cartera de inversión de la Sociedad de Inversión

COMPOSICIÓN POR CLASE DE ACTIVO	TRAYECTORIA DE INVERSIÓN	SOCIEDAD DE INVERSIÓN
DEP-EFECTIVO	0.00%	0.00%
DEUDA NACIONAL	15.01%	25.44%
DEUDA EXTRANJERA	0.00%	0.00%
DIVISAS	0.00%	0.07%
ESTRUCTURADO	17.43%	10.82%
FIBRAS	7.82%	4.42%
GUBERNAMENTAL	31.28%	26.17%
OTROS	0.00%	0.00%
RENTA VARIABLE EXTRANJERA	18.28%	22.05%
RENTA VARIABLE NACIONAL	10.18%	8.56%
REPO	0.00%	2.48%