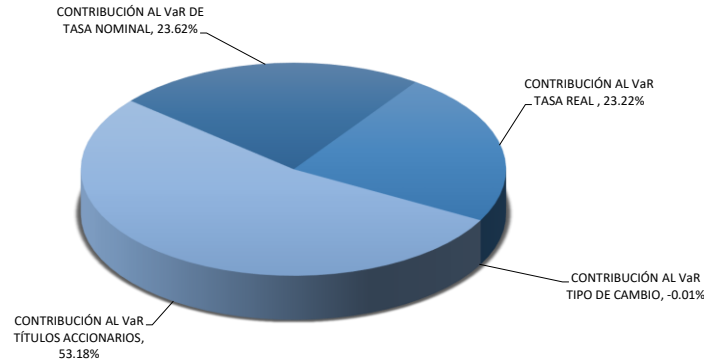


**RIESGO DE MERCADO**

Valor en Riesgo (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR DE TASA NOMINAL</b>	<b>0.143702%</b>
CUPÓN CERO TASA NOMINAL	0.005754%
TASA FIJA TASA NOMINAL	0.137949%
TASA VARIABLE NOMINAL	-0.000001%
SUBYACENTE	0.000000%
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR TASA REAL</b>	<b>0.141273%</b>
CUPÓN CERO TASA REAL	0.000000%
TASA FIJA TASA REAL	0.141273%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.000000%
SUBYACENTE TASA REAL	0.000000%
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR TIPO DE CAMBIO</b>	<b>-0.000079%</b>
USD	-0.000079%
EUR	0.000000%
JPY	0.000000%
OTROS	0.000000%
SUBYACENTE	0.000000%
<b>CONTRIBUCIÓN AL VaR TÍTULOS ACCIONARIOS</b>	<b>0.323568%</b>
SUBYACENTE	0.000000%
<b>VaR TOTAL*</b>	<b>0.608464%</b>

**Contribución al VaR por factores de riesgo**



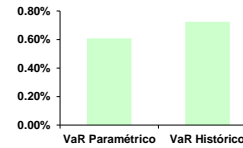
ACTIVO NETO
30/09/2024
80,356,931,737.62

\* 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
	0.723730%

\* 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

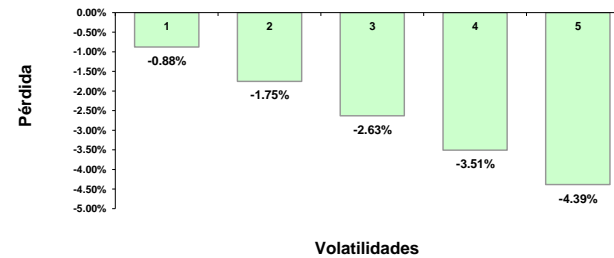


**Análisis de Sensibilidad**

MOVIMIENTO EN VALOR DE MERCADO POR N VOLATILIDADES *	IMPORTE CON INTERESES STRESS	PÉRDIDA STRESS	PÉRDIDA STRESS PORC
1	82,080,838,769.33	-726,279,909.76	-0.88%
2	81,354,558,859.57	-1,452,559,819.53	-1.75%
3	80,628,278,949.81	-2,178,839,729.29	-2.63%
4	79,901,999,040.04	-2,905,119,639.05	-3.51%
5	79,175,719,130.28	-3,631,399,548.82	-4.39%

\* 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	942,054.16	0.00%
TASA FIJA TASA NOMINAL	60,480,664.05	0.08%
TASA VARIABLE NOMINAL	46,567,956.05	0.06%
CUPÓN CERO TASA REAL	0.00	0.00%
TASA FIJA TASA REAL	47,572,685.80	0.06%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.00	0.00%
<b>TOTAL</b>	<b>155,563,360.05</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	55,913,332.23	0.07%
AA	40,438,841.69	0.05%
A	9,935,080.52	0.01%
BBB	49,276,105.61	0.06%
<b>TOTAL</b>	<b>155,563,360.05</b>	<b>0.19%</b>

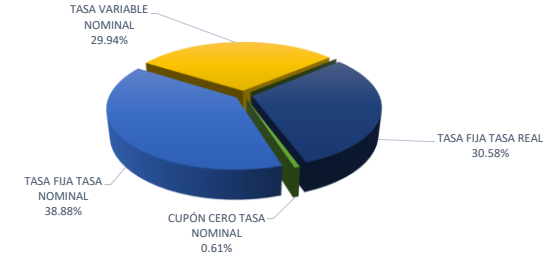
Exposición de Riesgo de Crédito por Plazo

PLAZO AL VENCIMIENTO	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO \$	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO
0-360 días	238,672.93	0.00%
361-720 días	2,931,940.88	0.00%
721-1092 días	26,708,689.03	0.03%
1093-1820 días	23,833,245.85	0.03%
1821-3600 días	27,547,354.69	0.03%
Más de 3600 días	74,303,456.67	0.09%
<b>TOTAL</b>	<b>155,563,360.05</b>	<b>0.19%</b>

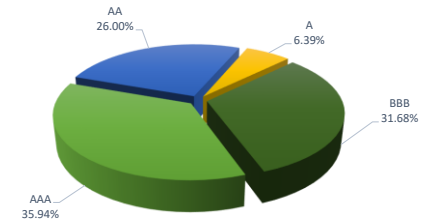
Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

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	46,604,457.25	0.06%
Productos de consumo frecuente	4,314,966.06	0.01%
Salud	378.19	0.00%
Servicios de telecomunicaciones	9,637,169.17	0.01%
Servicios financieros	25,973,037.46	0.03%
Servicios públicos	6,463,103.35	0.01%
Servicios y bienes de consumo no básico	22,130,268.32	0.03%
Hipotecario-Vivienda	22,736,173.31	0.03%
Fideicomisos Carreteros	17,703,806.94	0.02%
<b>TOTAL</b>	<b>155,563,360.05</b>	<b>0.19%</b>

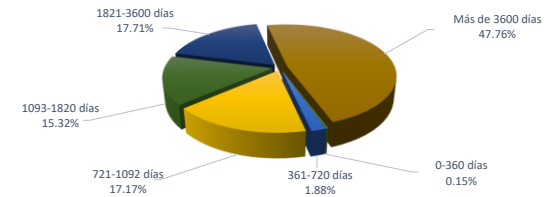
Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa



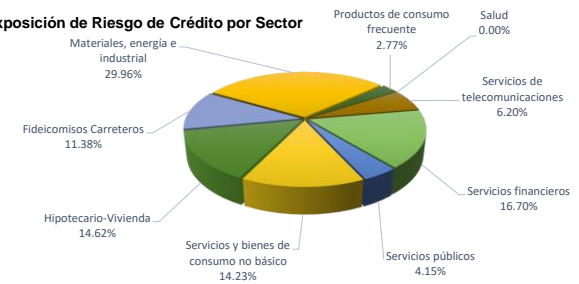
Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia



Exposición de Riesgo de Crédito por Plazo



Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

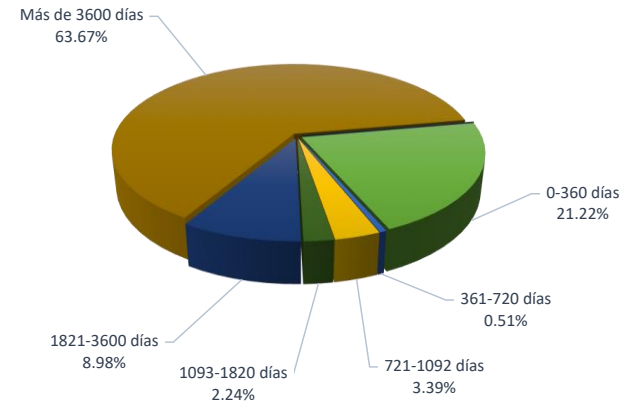


**RIESGO DE LIQUIDEZ**

Desglose por plazo de los vencimientos.

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL
0-360 días	219,544,912.05
361-720 días	5,238,221.68
721-1092 días	35,114,156.79
1093-1820 días	23,160,263.83
1821-3600 días	92,869,979.68
Más de 3600 días	658,689,582.76
<b>TOTAL</b>	<b>1,034,617,116.79</b>

**Desglose por plazo de los vencimientos**



**RENDIMIENTO**

<b>Cifras al cierre de agosto de 2024</b>
<b>5.28%</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>	<b>2.80%</b>
--	--------------

**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	14.98%	24.21%
DEUDA EXTRANJERA	0.00%	0.00%
DIVISAS	0.00%	0.06%
ESTRUCTURADO	20.00%	10.86%
FIBRAS	8.42%	4.14%
GUBERNAMENTAL	17.96%	26.56%
OTROS	0.00%	0.00%
RENTA VARIABLE EXTRANJERA	20.00%	20.56%
RENTA VARIABLE NACIONAL	18.64%	10.57%
REPO	0.00%	3.05%