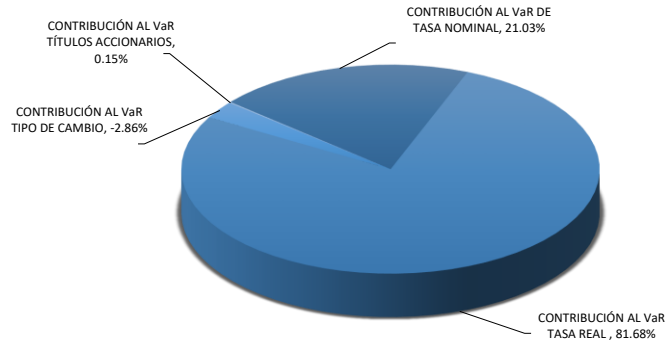


RIESGO DE MERCADO

Valor en Riesgo (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
CONTRIBUCIÓN AL VaR DE TASA NOMINAL	0.100262%
CUPÓN CERO TASA NOMINAL	0.002094%
TASA FIJA TASA NOMINAL	0.098168%
TASA VARIABLE NOMINAL	0.000000%
SUBYACENTE	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TASA REAL	0.389396%
CUPÓN CERO TASA REAL	0.000000%
TASA FIJA TASA REAL	0.389396%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.000000%
SUBYACENTE TASA REAL	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TIPO DE CAMBIO	-0.013619%
USD	-0.013619%
EUR	0.000000%
JPY	0.000000%
OTROS	0.000000%
SUBYACENTE	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TÍTULOS ACCIONARIOS	0.000707%
SUBYACENTE	0.000000%
VaR TOTAL*	0.476745%

Contribución al VaR por factores de riesgo



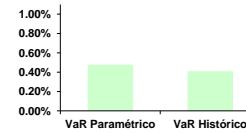
ACTIVO NETO
31/10/2024
4,063,011,107.35

* 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
	0.409740%

* 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

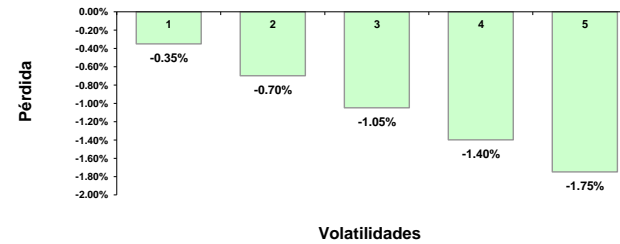


Análisis de Sensibilidad

MOVIMIENTO EN VALOR DE MERCADO POR N VOLATILIDADES *	IMPORTE CON INTERESES STRESS	PÉRDIDA STRESS	PÉRDIDA STRESS PORC
1	4,191,745,099.55	-14,707,248.25	-0.35%
2	4,177,037,851.30	-29,414,496.50	-0.70%
3	4,162,330,603.05	-44,121,744.76	-1.05%
4	4,147,623,354.80	-58,828,993.01	-1.40%
5	4,132,916,106.55	-73,536,241.26	-1.75%

* 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	7,224.24	0.00%
TASA FIJA TASA NOMINAL	3,733,591.47	0.09%
TASA VARIABLE NOMINAL	4,159,149.14	0.10%
CUPÓN CERO TASA REAL	0.00	0.00%
TASA FIJA TASA REAL	2,056,203.02	0.05%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.00	0.00%
TOTAL	9,956,167.88	0.25%

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	2,887,476.60	0.07%
AA	1,558,281.51	0.04%
A	1,089,490.53	0.03%
BBB	4,420,919.24	0.11%
TOTAL	9,956,167.88	0.25%

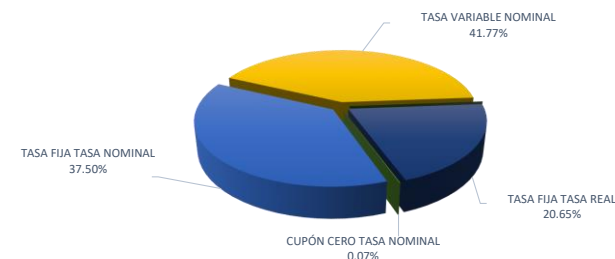
Exposición de Riesgo de Crédito por Plazo

PLAZO AL VENCIMIENTO	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO \$	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO
0-360 días	102,036.11	0.00%
361-720 días	362,386.72	0.01%
721-1092 días	2,091,605.97	0.05%
1093-1820 días	672,704.48	0.02%
1821-3600 días	807,463.44	0.02%
Más de 3600 días	5,919,971.17	0.15%
TOTAL	9,956,167.88	0.25%

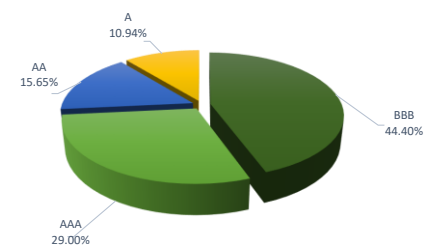
Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

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	4,288,098.88	0.11%
Productos de consumo frecuente	91,516.24	0.00%
Salud	929.88	0.00%
Servicios de telecomunicaciones	111,280.44	0.00%
Servicios financieros	1,467,136.86	0.04%
Servicios públicos	156,983.27	0.00%
Servicios y bienes de consumo no básico	1,023,260.35	0.03%
Hipotecario-Vivienda	1,414,222.15	0.03%
Fideicomisos Carreteros	1,402,739.80	0.03%
TOTAL	9,956,167.88	0.25%

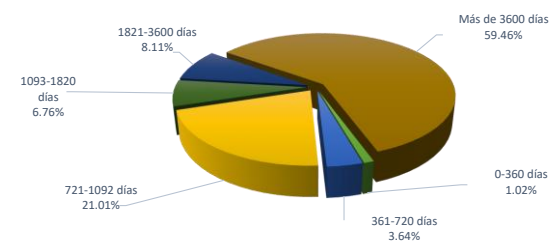
Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa



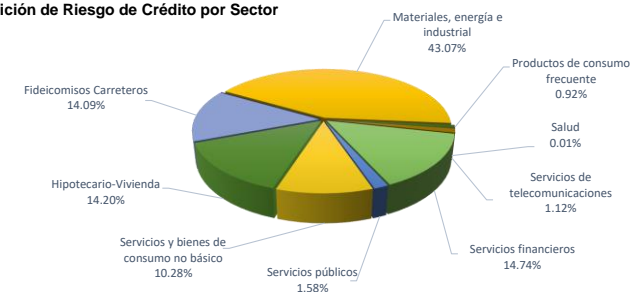
Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia



Exposición de Riesgo de Crédito por Plazo



Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

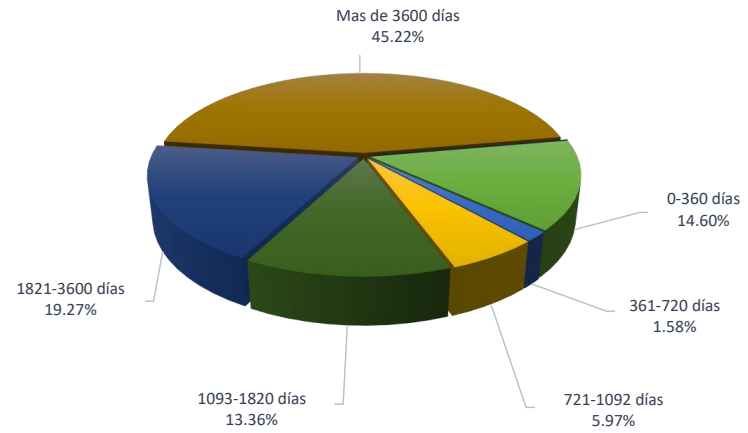


RIESGO DE LIQUIDEZ

Desglose por plazo de los vencimientos.

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL
0-360 días	8,558,887.69
361-720 días	927,947.53
721-1092 días	3,501,269.63
1093-1820 días	7,830,724.82
1821-3600 días	11,293,591.98
Mas de 3600 días	26,505,363.33
TOTAL	58,617,784.98

Desglose por plazo de los vencimientos



RENDIMIENTO

Cifras al cierre de septiembre de 2024	
	5.85%

ESTRUCTURA DE COMISIONES

Comisiones por administración de cuenta individual

COMISIONES VARIABLES	
Conceptos	Comisión
Comisión sobre Saldo	0.566% anual sobre el saldo administrado

COMISIONES POR CUOTA FIJA	
Conceptos	Comisión
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

ERROR DE SEGUIMIENTO ANUALIZADO	2.50%
--	--------------

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-EFFECTIVO	0.00%	0.00%
DEUDA NACIONAL	0.00%	30.57%
DEUDA EXTRANJERA	0.00%	0.00%
DIVISAS	0.00%	2.47%
ESTRUCTURADO	0.00%	0.00%
FIBRAS	0.00%	1.55%
GUBERNAMENTAL	100.00%	61.76%
OTROS	0.00%	0.00%
RENTA VARIABLE EXTRANJERA	0.00%	0.00%
RENTA VARIABLE NACIONAL	0.00%	0.12%
REPO	0.00%	3.53%