

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			482,140,140	29.93%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	482,140,140	29.93%
	Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Accione			54,049,398	3.36%
1B	DIABLOI	10	Media	45,604,697	2.83%
1B	ANGELD	10	Media	8,444,701	0.52%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			141,733,875	8.80%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	141,733,875	8.80%
	Chequera Dolares			306,024,308	19.00%
CHD	40-110	1966567		298,270,029	18.52%
CHD	40-133	8658940		7,754,279	0.48%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			198,141,903	12.30%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	198,141,903	12.30%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			80,771,603	5.01%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	60,540,262	3.76%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	20,231,341	1.26%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			38,912,386	2.42%
1ISP	EWV	*	Alta	30,530,273	1.90%
1ISP	BBIL	N	Alta	8,382,113	0.52%
	Reportos			309,108,890	19.19%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	309,108,890	19.19%
	TOTAL CARTERA			1,610,882,503	100.00%
	ACTIVO NETO			1,616,109,204	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.412 %

Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."