

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			287,860,533	18.71%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	287,860,533	18.71%
	Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Ac			53,895,699	3.50%
1B	DIABLOI	10	Baja	45,073,528	2.93%
1B	ANGELD	10	Media	8,822,172	0.57%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			140,023,740	9.10%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	140,023,740	9.10%
	Chequera Dolares			295,224,196	19.19%
CHD	40-110	1966567		289,615,223	18.82%
CHD	40-133	8658940		5,608,974	0.37%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			191,076,090	12.42%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	191,076,090	12.42%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			78,145,000	5.08%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	58,586,546	3.81%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	19,558,454	1.27%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			38,498,757	2.50%
1ISP	EWW	*	Alta	30,410,731	1.98%
1ISP	BBIL	N	Alta	8,088,026	0.53%
	Reportos			353,386,855	22.97%
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	353,386,855	22.97%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			100,444,799	6.53%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,444,799	6.53%
	TOTAL CARTERA			1,538,555,669	100.00%
	ACTIVO NETO			1,544,080,424	

Cartera al:

19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.324 %

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."
