

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			85,434,431	24.25%
1	PASA	B	Minima	45,353,983	12.87%
1	PINFRA	L	Media	22,033,643	6.25%
1	FRAGUA	B	Media	11,384,759	3.23%
1	FEMSA	UB	Baja	6,662,046	1.89%
	Acciones de Aseguradoras Afianzadoras y Arrendad			298,513	0.09%
0	CREAL	*	Nula	298,513	0.09%
	Certificados Bursátiles Bancarios			13,330,711	3.78%
94	BINTER	16U	AAA (mex)	13,330,711	3.78%
	Certificados Bursátiles Corporativos			109,569,015	31.10%
91	OSM	15U	mxAA-	19,062,793	5.41%
91	CEMEX	23L	AA (mex)	15,085,288	4.28%
91	INVEX	23	A+ (mex)	15,075,553	4.28%
91	SORIANA	23	AAA (mex)	10,087,372	2.86%
91	ARA	23X	mxAA-	10,081,475	2.86%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	10,059,333	2.86%
91	AMX	22	AAA (mex)	10,056,222	2.85%
91	GAP	23L	mxAAA	10,032,900	2.85%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	10,028,081	2.85%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			29,805,771	8.46%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	19,843,978	5.63%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,961,793	2.83%
	Chequera Dolares			0	0.00%
CHD	40-133	8151003		0	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			5,119,031	1.45%
1ASP	BABA	N	Alta	5,119,031	1.45%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			33,889,745	9.62%
93	AMX	12424	F1+ (mex)	18,979,705	5.39%

93	AMX	04724	F1+ (mex)	14,910,040	4.23%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			4,934,494	1.40%
1ISP	MCHI	*	Alta	4,934,494	1.40%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			10,061,221	2.86%
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	10,061,221	2.86%
	Udibonos			25,712,837	7.30%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	14,915,345	4.23%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	10,797,492	3.07%
	Reportos			34,142,686	9.69%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	34,142,686	9.69%
	TOTAL CARTERA			352,298,455	100.00%
	ACTIVO NETO			352,125,386	

Cartera al: 19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 3.000 % Var Promedio: 0.271 %

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."