

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			710,175,450	41.94%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	415,807,332	24.56%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	294,368,118	17.39%
	Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Accione			44,065,334	2.60%
1B	DIABLOI	10	Baja	38,825,919	2.29%
1B	ANGELD	10	Media	5,239,415	0.31%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			138,984,510	8.21%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	138,984,510	8.21%
	Chequera Dolares			35,288,381	2.08%
CHD	40-110	1966567		19,808,050	1.17%
CHD	40-133	8658940		15,480,331	0.91%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			194,593,458	11.49%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	194,593,458	11.49%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			79,422,694	4.69%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	59,537,657	3.52%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	19,885,037	1.17%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			38,141,733	2.25%
1ISP	EWV	*	Alta	29,905,658	1.77%
1ISP	BBIL	N	Alta	8,236,075	0.49%
	Reportos			351,789,122	20.78%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	351,789,122	20.78%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			100,744,282	5.95%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,744,282	5.95%
	TOTAL CARTERA			1,693,204,964	100.00%
	ACTIVO NETO			1,411,110,601	

Cartera al:

30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.230 %

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."