

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			483,047,530	29.51%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	483,047,530	29.51%
	Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Accione			55,043,599	3.36%
1B	DIABLOI	10	Media	47,160,265	2.88%
1B	ANGELD	10	Media	7,883,334	0.48%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			142,023,225	8.68%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	142,023,225	8.68%
	Chequera Dolares			253,607,646	15.50%
CHD	40-110	1966567		245,634,819	15.01%
CHD	40-133	8658940		7,972,827	0.49%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			203,898,706	12.46%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	203,898,706	12.46%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			83,086,111	5.08%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	62,270,638	3.81%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	20,815,473	1.27%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			38,111,744	2.33%
1ISP	EWV	*	Alta	29,489,725	1.80%
1ISP	BBIL	N	Alta	8,622,019	0.53%
	Reportos			377,921,739	23.09%
IM	BPAG28	271104	AAA(mex)	299,137,123	18.28%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	78,784,617	4.81%
	TOTAL CARTERA			1,636,740,300	100.00%
	ACTIVO NETO			1,642,837,789	

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.404 %

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."