

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,596,443,588	19.64%
1ISP	IB01	N	N/A	1,142,326,229	14.06%
1ISP	VDST	N	N/A	454,117,359	5.59%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				1,546,395,771	19.03%
FSP	BACMEXT	D24008	F1+ (mex)	173,753,165	2.14%
FSP	BACMEXT	D24009	F1+ (mex)	174,780,171	2.15%
FSP	NAFIN	D24062	F1+ (mex)	175,031,604	2.15%
FSP	NAFIN	D24064	F1+ (mex)	174,818,737	2.15%
FSP	NAFIN	D24067	F1+ (mex)	174,491,348	2.15%
FSP	NAFIN	D24069	F1+ (mex)	174,397,194	2.15%
FSP	NAFIN	D24071	F1+ (mex)	174,242,974	2.14%
FSP	NAFIN	D24073	F1+ (mex)	324,880,578	4.00%
Chequera Dolares				4,984,585,183	61.33%
CHD	37-006	4006562		1,769,214,504	21.77%
CHD	37-135	6009236		1,760,506,385	21.66%
CHD	40-002	9409199		300,164	0.00%
CHD	40-012	6539459		291,459,358	3.59%
CHD	40-044	0941285		1,163,104,773	14.31%
TOTAL CARTERA				8,127,424,542	100.00%
ACTIVO NETO				8,120,993,776	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 2.50%

Var Promedio:

1.0530%

Parametros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana. *De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV