



FT-DYNA FRANKLIN TEMPLETON MULTI ACTIVO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
CARTERA DE VALORES AL 30 AGOSTO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Entidad Emisora	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO							
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL							
MP	BONOS	270603	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	49,735,830	382,432,275.28	75.85
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS							
94	BACOMER	19-2	BBVA MÉXICO, S.A.INSTITU(AAA.mx		200,000	19,614,940.40	3.89
94	HSBC	17-2	HSBC MEXICO, S.A.,INSTITU AAA.mx		150,000	14,877,063.75	2.95
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS							
91	GMXT	17	GMÉXICO TRANSPORTES, S mxAAA		180,000	17,423,012.16	3.46
91	CETEMEM	22-4	CETEMEM, S.A. DE C.V. SOF mxAAA		122,000	12,703,677.49	2.52
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL							
95	CFE	17	COMISION FEDERAL DE ELÉ mxAAA		250,000	23,278,944.25	4.62
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO						470,329,913.33	93.29
REPORTO							
M	BONOS	240905	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	284,377	29,562,271.51	5.86
TOTAL REPORTO						29,562,271.51	5.86
OTROS VALORES					45,043	4,286,291.71	0.85
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES						504,178,476.55	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AA+/S4(mex)

VaR Promedio
0.377%

Límite de VaR
0.85%

El VaR es una medida estadística que se estima con un nivel de confianza del 95% y un período de un 1 día, lo cual significa que, en el 95% de los casos, la pérdida potencial debería ser menor al VaR determinado. Para calcular este valor, se utilizará el método Montecarlo.

HUGO PETRICIOLI CASTELLON

Este documento ha sido elaborado por Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión con la finalidad de proporcionar a los inversionistas información financiera general relativa a los fondos y los activos objeto de inversión en los que invierten en términos de lo requerido por la regulación aplicable en los Estados Unidos Mexicanos. El contenido del presente documento proviene de fuentes consideradas como fidedignas, sin embargo, no se ofrece garantía alguna, ni representa una sugerencia para la toma de decisiones en materia de inversión. En caso de requerir la composición de la cartera del Fondo Subyacente, usted podrá consultar esta información dentro de los archivos Factsheets-Reportes Mensuales en el siguiente link: http://www.franklintempleton.com.mx/es_MX/public/fondos/factsheets-folletos-comentarios.page. Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión no asume ningún tipo de responsabilidad en caso de que el presente documento sea interpretado como recomendación de compra o venta de cualquiera de los activos objeto de inversión que en el mismo se mencionan. Este documento no podrá ser reproducido o utilizado parcial o totalmente por ningún medio, ni ser distribuido, citado o divulgado sin el permiso previo por escrito de Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión. La información mostrada en la lista de Principales tenencias del Fondo Subyacente, son los últimos datos conocidos a la fecha. Cualquier duda favor de referirse a nuestra sección de Información Importante en la siguiente dirección electrónica: www.franklintempleton.com.mx.