

GOLD1+

AAAf/S2(mex)

BLK Portafolio Estratégico Gold Conservador, S.A. de C.V. F I I D

Corto Plazo General

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Cetes			6,683,148,690	73.7485%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	5,679,242,773	62.6704%
BI	CETES	250904	AAA(mex)	704,922,040	7.7788%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	167,581,218	1.8493%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	91,638,589	1.0112%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	39,764,071	0.4388%
	Fondos de Inversión de Deuda			2,378,933,477	26.2515%
51	BLKDIN	M0-A	AAA/2(mex)	1,364,177,249	15.0537%
51	BLKCOR	M0-A	AAA/4(mex)	625,365,693	6.9009%
51	BLKGUB1	M0-F	AAA/2(mex)	389,390,535	4.2969%
	TOTAL CARTERA			9,062,082,167	100.0000%
	ACTIVO NETO			9,054,701,102	
	Límite máximo Valor Riesgo				0.1500%
	Promedio				0.0396%
	Cartera al:		30-Aug-24		
SUPUESTOS: Nivel de Confianza: 95%, Observaciones: 500, Ventana de Tiempo: 1 días					
METODOLOGÍA PARA CÁLCULO: VaR Histórico					
FECHA DE CÁLCULO DE VaR PROMEDIO: del 01-Ago-2024 al 30-Ago-2024					