

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			41,339,162	3.65%
1B	DIABLOI	10	Baja	34,798,334	3.07%
1B	ANGELD	10	Media	6,540,827	0.58%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			298,176,150	26.33%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	298,176,150	26.33%
	Chequera Dolares			122,960,592	10.86%
CHD	40-110	1966567		117,692,726	10.39%
CHD	40-133	8658940		5,267,865	0.47%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			49,914,796	4.41%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	49,914,796	4.41%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			135,669,399	11.98%
D5SP	TNOTR88	240531	AA+	67,808,725	5.99%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	50,867,933	4.49%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	16,992,740	1.50%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			39,862,120	3.52%
1ISP	EWV	*	Alta	32,961,187	2.91%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,900,932	0.61%
	Reportos			343,946,585	30.37%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	343,946,585	30.37%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			100,645,014	8.89%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,645,014	8.89%
	TOTAL CARTERA			1,132,513,818	100.00%
	ACTIVO NETO			1,127,474,528	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.268 %

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."
