

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			41,891,464	3.79%
1B	DIABLOI	10	Baja	35,571,631	3.22%
1B	ANGELD	10	Baja	6,319,833	0.57%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			295,617,000	26.77%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	295,617,000	26.77%
	Chequera Dolares			119,907,596	10.86%
CHD	40-110	1966567		115,224,892	10.43%
CHD	40-133	8658940		4,682,704	0.42%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			48,651,089	4.41%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	48,651,089	4.41%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			132,198,011	11.97%
D5SP	TNOTR88	240531	AA+	66,092,795	5.99%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	49,549,778	4.49%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	16,555,439	1.50%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			39,026,024	3.53%
1ISP	EWV	*	Alta	32,298,867	2.93%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,727,158	0.61%
	Reportos			326,370,106	29.56%
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	326,370,106	29.56%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			100,632,834	9.11%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,632,834	9.11%
	TOTAL CARTERA			1,104,294,124	100.00%
	ACTIVO NETO			1,105,808,289	

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.252 %

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."