

### DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>41,790,190</b>	<b>3.71%</b>
1B	DIABLOI	10	Baja	35,507,189	3.15%
1B	ANGELD	10	Media	6,283,000	0.56%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>297,556,170</b>	<b>26.39%</b>
BI	CETES	240530	AAA(mex)	297,556,170	26.39%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>123,833,522</b>	<b>10.98%</b>
CHD	40-110	1966567		118,991,903	10.55%
CHD	40-133	8658940		4,841,620	0.43%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>50,461,963</b>	<b>4.48%</b>
D4SP	TBILB79	240711	AA+	50,461,963	4.48%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>137,110,359</b>	<b>12.16%</b>
D5SP	TNOTR88	240531	AA+	68,543,817	6.08%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	51,398,191	4.56%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	17,168,351	1.52%
	<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>39,140,913</b>	<b>3.47%</b>
1ISP	EWV	*	Alta	32,165,405	2.85%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,975,509	0.62%
	<b>Reportos</b>			<b>337,110,482</b>	<b>29.90%</b>
LD	BONDES	240530	AAA(mex)	337,110,482	29.90%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>100,426,653</b>	<b>8.91%</b>
LF	BONDES	241003	AAA(mex)	100,426,653	8.91%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,127,430,252</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,130,610,051</b>	

Cartera al: 02/05/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.269 %**

**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."**