

### DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>41,201,056</b>	<b>3.73%</b>
1B	DIABLOI	10	Baja	34,733,893	3.15%
1B	ANGELD	10	Media	6,467,163	0.59%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>294,656,130</b>	<b>26.71%</b>
BI	CETES	240530	AAA(mex)	294,656,130	26.71%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>120,654,627</b>	<b>10.94%</b>
CHD	40-110	1966567		116,428,492	10.55%
CHD	40-133	8658940		4,226,135	0.38%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>48,956,657</b>	<b>4.44%</b>
D4SP	TBILB79	240711	AA+	48,956,657	4.44%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>133,233,616</b>	<b>12.08%</b>
D5SP	TNOTR88	240531	AA+	66,477,946	6.03%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	50,044,202	4.54%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	16,711,467	1.52%
	<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>39,509,089</b>	<b>3.58%</b>
1ISP	EWV	*	Alta	32,741,783	2.97%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,767,306	0.61%
	<b>Reportos</b>			<b>324,822,158</b>	<b>29.44%</b>
LD	BONDES	251211	AAA(mex)	324,822,158	29.44%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>100,288,710</b>	<b>9.09%</b>
LF	BONDES	241003	AAA(mex)	100,288,710	9.09%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,103,322,043</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,102,614,584</b>	

Cartera al: 27/03/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.280 %**

**Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 día 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."**