

### DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>203,781,458</b>	<b>16.89%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	203,781,458	16.89%
	<b>Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Accione</b>			<b>43,390,242</b>	<b>3.60%</b>
1B	DIABLOI	10	Baja	38,117,064	3.16%
1B	ANGELD	10	Media	5,273,178	0.44%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>135,785,115</b>	<b>11.25%</b>
BI	CETES	250529	AAA(mex)	135,785,115	11.25%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>21,573,165</b>	<b>1.79%</b>
CHD	40-110	1966567		18,499,335	1.53%
CHD	40-133	8658940		3,073,830	0.26%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>235,113,521</b>	<b>19.49%</b>
D4SP	TBILP56	241129	AA+	179,993,292	14.92%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	55,120,229	4.57%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>74,877,628</b>	<b>6.21%</b>
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	56,129,779	4.65%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	18,747,849	1.55%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>37,229,353</b>	<b>3.09%</b>
1ISP	EWV	*	Alta	29,611,688	2.45%
1ISP	BBIL	N	Alta	7,617,665	0.63%
	<b>Reportos</b>			<b>354,448,422</b>	<b>29.38%</b>
BI	CETES	240808	AAA(mex)	354,448,422	29.38%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>100,438,905</b>	<b>8.32%</b>
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,438,905	8.32%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,206,637,809</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,207,079,158</b>	

Cartera al:

27/06/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.267 %**

**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."**