

### DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>41,744,165</b>	<b>3.70%</b>
1B	DIABLOI	10	Baja	35,442,748	3.14%
1B	ANGELD	10	Baja	6,301,417	0.56%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>297,466,590</b>	<b>26.34%</b>
BI	CETES	240530	AAA(mex)	297,466,590	26.34%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>125,275,108</b>	<b>11.09%</b>
CHD	40-110	1966567		120,395,321	10.66%
CHD	40-133	8658940		4,879,787	0.43%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>50,846,805</b>	<b>4.50%</b>
D4SP	TBILB79	240711	AA+	50,846,805	4.50%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>138,095,040</b>	<b>12.23%</b>
D5SP	TNOTR88	240531	AA+	69,068,610	6.12%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	51,740,345	4.58%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	17,286,085	1.53%
	<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>39,119,312</b>	<b>3.46%</b>
1ISP	EWV	*	Alta	32,092,903	2.84%
1ISP	BBIL	N	Alta	7,026,409	0.62%
	<b>Reportos</b>			<b>336,373,899</b>	<b>29.79%</b>
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	336,373,899	29.79%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>100,394,154</b>	<b>8.89%</b>
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,394,154	8.89%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,129,315,073</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,128,896,280</b>	

Cartera al: 30/04/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.258 %**

**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."**