

DISCRECIONAL

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

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 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."