

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			42,238,164	3.78%
1B	DIABLOI	10	Baja	36,151,603	3.24%
1B	ANGELD	10	Baja	6,086,561	0.55%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			296,274,840	26.54%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	296,274,840	26.54%
	Chequera Dolares			124,549,408	11.16%
CHD	40-110	1966567		119,689,797	10.72%
CHD	40-133	8658940		4,859,610	0.44%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			50,540,570	4.53%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	50,540,570	4.53%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			137,310,806	12.30%
D5SP	TNOTR88	240531	AA+	68,656,966	6.15%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	51,461,452	4.61%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	17,192,388	1.54%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			38,676,528	3.46%
1ISP	EWV	*	Alta	31,688,018	2.84%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,988,509	0.63%
	Reportos			326,898,344	29.28%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	326,898,344	29.28%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			99,987,883	8.96%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	99,987,883	8.96%
	TOTAL CARTERA			1,116,476,543	100.00%
	ACTIVO NETO			1,117,414,237	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.253 %

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."
