

### DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>203,321,054</b>	<b>16.88%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	203,321,054	16.88%
	<b>Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Accione</b>			<b>43,289,015</b>	<b>3.59%</b>
1B	DIABLOI	10	Baja	37,859,299	3.14%
1B	ANGELD	10	Media	5,429,716	0.45%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>135,452,325</b>	<b>11.25%</b>
BI	CETES	250529	AAA(mex)	135,452,325	11.25%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>21,510,772</b>	<b>1.79%</b>
CHD	40-110	1966567		18,443,380	1.53%
CHD	40-133	8658940		3,067,392	0.26%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>234,376,349</b>	<b>19.46%</b>
D4SP	TBILP56	241129	AA+	179,425,828	14.90%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	54,950,520	4.56%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>74,661,309</b>	<b>6.20%</b>
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	55,969,421	4.65%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	18,691,888	1.55%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>37,649,216</b>	<b>3.13%</b>
1ISP	EWV	*	Alta	30,054,924	2.50%
1ISP	BBIL	N	Alta	7,594,291	0.63%
	<b>Reportos</b>			<b>353,956,974</b>	<b>29.39%</b>
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	353,956,974	29.39%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>100,222,968</b>	<b>8.32%</b>
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,222,968	8.32%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,204,439,982</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,197,031,570</b>	

Cartera al:

20/06/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.265 %**

**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."**