

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			205,069,954	16.39%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	205,069,954	16.39%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			43,483,866	3.48%
1B	DIABLOI	10	Baja	38,084,844	3.04%
1B	ANGELD	10	Baja	5,399,022	0.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			136,554,780	10.91%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	136,554,780	10.91%
	Chequera Dolares			111,543,940	8.91%
CHD	40-110	1966567		107,980,869	8.63%
CHD	40-133	8658940		3,563,071	0.29%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			176,353,790	14.09%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	176,353,790	14.09%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			73,076,003	5.84%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	55,095,005	4.40%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	17,980,999	1.44%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			37,482,207	3.00%
1ISP	EWV	*	Alta	30,015,890	2.40%
1ISP	BBIL	N	Alta	7,466,317	0.60%
	Reportos			367,536,619	29.37%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	367,536,619	29.37%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			100,229,054	8.01%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,229,054	8.01%
	TOTAL CARTERA			1,251,330,213	100.00%
	ACTIVO NETO			1,252,306,930	

Cartera al:

18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.270 %

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."