

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			202,182,954	13.61%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	202,182,954	13.61%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			42,686,153	2.87%
1B	DIABLOI	10	Baja	36,731,575	2.47%
1B	ANGELD	10	Media	5,954,578	0.40%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			134,832,480	9.08%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	134,832,480	9.08%
	Chequera Dolares			78,975,808	5.32%
CHD	40-110	1966567		68,454,633	4.61%
CHD	40-133	8658940		10,521,175	0.71%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			215,880,299	14.53%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	165,263,574	11.13%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	50,616,725	3.41%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			68,730,424	4.63%
D5SP	TNOTN48	250731	AA+	51,519,516	3.47%
D5SP	TNOTL81	250630	AA+	17,210,909	1.16%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			38,509,247	2.59%
1ISP	EWV	*	Alta	31,514,076	2.12%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,995,172	0.47%
	Reportos			603,049,283	40.60%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	506,153,563	34.08%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	96,895,721	6.52%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			100,526,115	6.77%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	100,526,115	6.77%
	TOTAL CARTERA			1,485,372,763	100.00%
	ACTIVO NETO			1,148,042,016	

Cartera al:

31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 2.900 % Var Promedio: 0.280 %

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."