

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,493,970,563	56.28%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	962,617,100	36.27%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	387,229,560	14.59%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	144,123,903	5.43%
Chequera Dolares				6,795,345	0.26%
CHD	40-133	1648040		6,795,345	0.26%
Forward de Divisas				-31,017	0.00%
FWD	MXPUSD	251024		-31,017	0.00%
Opciones CALL Divisas				29,442,045	1.11%
CALL	SPX	250930		29,442,045	1.11%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				783,112,513	29.50%
1ISP	BBUS	*	Alta	288,943,075	10.89%
1ISP	SPXL	*	Alta	252,235,525	9.50%
1ISP	SHY	*	Alta	241,933,913	9.12%
Reportos				341,075,401	12.85%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	341,075,401	12.85%
TOTAL CARTERA				2,654,364,850	100.00%
ACTIVO NETO				2,652,025,707	
Cartera al:		30/04/2025			

Límite Máximo de VaR:

4.800 % Var Promedio: 0.713 %

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."