

## DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>113,362,728</b>	<b>8.72%</b>
CHD	40-133	1648040		113,362,728	8.72%
	<b>Acciones de Fondos de Inversión</b>			<b>488,126,906</b>	<b>37.55%</b>
52	ACTI500	FF		488,126,906	37.55%
	<b>Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu</b>			<b>542,333,259</b>	<b>41.72%</b>
51	ACTICOB	FF	HR AAA	542,333,259	41.72%
	<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot</b>			<b>154,980,400</b>	<b>11.92%</b>
1ISP	SPY	*	Alta	102,199,579	7.86%
1ISP	SHV	*	Alta	37,007,532	2.85%
1ISP	BBUS	*	Alta	15,773,289	1.21%
	<b>Reportos</b>			<b>1,005,746</b>	<b>0.08%</b>
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	1,005,746	0.08%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,299,809,039</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,299,142,040</b>	

Cartera al: 09/05/2024

**Límite Máximo de VaR: 3.800 % Var Promedio: 0.592 %**  
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."