

## DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>468,213</b>	<b>16.77%</b>
CHD	40-133	8019333		468,213	16.77%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>1,784,932</b>	<b>63.93%</b>
1ISP	SHV	*	Alta	1,382,611	49.52%
1ISP	SPY	*	Alta	402,321	14.41%
	<b>Reportos</b>			<b>538,816</b>	<b>19.30%</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	538,816	19.30%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,791,961</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,783,555</b>	
	<b>Cartera al:</b>	<b>27/06/2024</b>			

**Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.701 %**

**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."