

## DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>9,830,288</b>	<b>0.46%</b>
CHD	40-133	8033359		9,830,288	0.46%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>2,110,286,489</b>	<b>99.49%</b>
1ISP	BBUS	*	Alta	1,037,281,449	48.90%
1ISP	VAGU	N	Alta	371,018,116	17.49%
1ISP	BBEU	*	Alta	235,788,749	11.12%
1ISP	JPEM	*	Alta	145,202,735	6.85%
1ISP	JGHY	N	Alta	125,765,556	5.93%
1ISP	BBJP	*	Alta	108,337,042	5.11%
1ISP	BBAX	*	Alta	41,643,840	1.96%
1ISP	EMGA	N	Alta	41,365,805	1.95%
1ISP	BIL	*	Alta	3,883,197	0.18%
	<b>Reportos</b>			<b>957,319</b>	<b>0.05%</b>
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	957,319	0.05%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,121,074,096</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,118,705,874</b>	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 3.000 % Var Promedio: 0.834 %

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."

