

### DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Industriales Comerciales y de Servicios</b>			<b>164,741,035</b>	<b>10.20%</b>
1	CEMEX	CPO	Alta	89,275,070	5.53%
1	ARA	*	Media	75,465,965	4.67%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>31</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8353344		31	0.00%
	<b>Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)</b>			<b>1,445,923,176</b>	<b>89.52%</b>
1ASP	MGA	N	Alta	174,530,275	10.81%
1ASP	ATSG	*	Alta	157,949,516	9.78%
1ASP	NTR	N	Alta	138,843,011	8.60%
1ASP	WBA	*	Alta	89,257,962	5.53%
1ASP	JACK	*	Alta	77,685,035	4.81%
1ASP	ERJ	N	Alta	74,032,766	4.58%
1ASP	WBD	*	Alta	68,140,287	4.22%
1ASP	GT	*	Alta	65,431,203	4.05%
1ASP	PARA	*	Alta	59,008,223	3.65%
1ASP	META	*	Alta	58,815,391	3.64%
1ASP	JBLU	*	Alta	54,046,805	3.35%
1ASP	PYPL	*	Alta	52,287,013	3.24%
1ASP	JWN	*	Alta	52,162,113	3.23%
1ASP	GNRC	*	Alta	51,381,571	3.18%
1ASP	OI	*	Alta	50,860,109	3.15%
1ASP	KSS	*	Alta	47,448,339	2.94%
1ASP	WHR	*	Alta	47,009,268	2.91%
1ASP	QCOM	*	Alta	45,910,910	2.84%
1ASP	GOOG	*	Alta	42,682,856	2.64%
1ASP	SHOP	N	Alta	38,440,524	2.38%
	<b>Reportos</b>			<b>4,589,270</b>	<b>0.28%</b>
BI	CETES	240808	AAA(mex)	4,589,270	0.28%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,615,253,512</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,617,124,274</b>	

Cartera al:

31/05/2024

**Límite Máximo de VaR: 6.500 % Var Promedio: 1.822 %**

**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."**