

DISCRECIONAL

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|---|-------------------|------------|------------------|----------------|
| | Chequera Dolares | | | 556,298 | 17.85% |
| CHD | 40-133 | 8019333 | | 556,298 | 17.85% |
| | Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras | | | 1,998,213 | 64.11% |
| 1ISP | SHV | * | Alta | 1,512,131 | 48.51% |
| 1ISP | SPY | * | Alta | 486,082 | 15.60% |
| | Reportos | | | 562,449 | 18.05% |
| IQ | BPAG91 | 270107 | AAA(mex) | 562,449 | 18.05% |
| | TOTAL CARTERA | | | 3,116,960 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 3,086,690 | |
| | Cartera al: | 26/12/2024 | | | |

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.951 %

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."