

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			1,260,826	0.05%
CHD	40-133	8033359		1,260,826	0.05%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,364,462,799	99.73%
1ISP	BBUS	*	Alta	1,160,705,593	48.96%
1ISP	VAGU	N	Alta	366,120,650	15.44%
1ISP	BBEU	*	Alta	295,940,236	12.48%
1ISP	JPEM	*	Alta	166,345,640	7.02%
1ISP	JGHY	N	Alta	164,490,980	6.94%
1ISP	BBJP	*	Alta	110,761,216	4.67%
1ISP	BBAX	*	Alta	47,539,236	2.01%
1ISP	EMGA	N	Alta	47,062,311	1.99%
1ISP	BBIL	N	Alta	5,496,936	0.23%
	Reportos			5,071,005	0.21%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	5,071,005	0.21%
	TOTAL CARTERA			2,370,794,630	100.00%
	ACTIVO NETO			2,364,921,443	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 3.000 % Var Promedio: 0.804 %

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."