

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			205,507	2.30%
CHD	40-133	8153199		205,507	2.30%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			7,405,754	82.97%
IISP	AZTD	*	Alta	7,405,754	82.97%
	Reportos			1,314,166	14.72%
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	1,314,166	14.72%
	TOTAL CARTERA			8,925,427	100.00%
	ACTIVO NETO			12,248,468	
	Cartera al:	11/04/2024			

Límite Máximo de VaR: 4.130 % Var Promedio: 1.334 %
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."