

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			429,023	0.03%
CHD	40-133	1648040		429,023	0.03%
	Acciones de Fondos de Inversión			621,841,430	39.50%
52	ACTI500	FF		621,841,430	39.50%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			931,300,388	59.16%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	931,300,388	59.16%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			20,049,468	1.27%
IISP	BBUS	*	Alta	20,049,468	1.27%
	Reportos			707,377	0.05%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	707,377	0.05%
	TOTAL CARTERA			1,574,327,686	100.00%
	ACTIVO NETO			1,573,615,472	
	Cartera al:	30/08/2024			

Límite Máximo de VaR: 3.800 % Var Promedio: 0.737 %

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."

