

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			465,099	16.75%
CHD	40-133	8019333		465,099	16.75%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,772,094	63.83%
1ISP	SHV	*	Alta	1,374,025	49.49%
1ISP	SPY	*	Alta	398,069	14.34%
	Reportos			539,318	19.42%
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	539,318	19.42%
	TOTAL CARTERA			2,776,511	100.00%
	ACTIVO NETO			2,767,694	
	Cartera al:	28/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.703 %

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."