

DISCRECIONAL					
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			973,003	28.89%
CHD	40-133	8019333		973,003	28.89%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,864,077	55.34%
1ISP	SHV	*	Alta	1,376,042	40.85%
1ISP	SPY	*	Alta	488,035	14.49%
	Reportos			531,376	15.78%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	531,376	15.78%
	TOTAL CARTERA			3,368,456	100.00%
	ACTIVO NETO			3,396,858	
	Cartera al:	30/09/202!	5		
		, ,			
	Límite Máximo de VaR:	3.200	% Var Promedio:	0.851 %	

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."