

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			923,787	0.04%
CHD	40-133	8033359		923,787	0.04%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,511,609,802	99.84%
1ISP	BBUS	*	Alta	1,275,146,134	50.69%
1ISP	VAGU	N	Alta	345,001,173	13.72%
1ISP	BBEU	*	Alta	287,798,423	11.44%
1ISP	JPEM	*	Alta	202,352,157	8.04%
1ISP	JGHY	N	Alta	175,353,429	6.97%
1ISP	BBJP	*	Alta	144,056,527	5.73%
1ISP	EMGA	N	Alta	50,673,463	2.01%
1ISP	BBAX	*	Alta	24,772,063	0.99%
1ISP	BBIL	N	Alta	6,456,432	0.26%
	Reportos			3,006,044	0.12%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	3,006,044	0.12%
	TOTAL CARTERA			2,515,539,633	100.00%
	ACTIVO NETO			2,512,695,956	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 3.000 % Var Promedio: 0.864 %

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."

