

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			43,190,575	1.98%
CHD	40-133	8033359		43,190,575	1.98%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,134,015,545	97.75%
1ISP	BBUS	*	Alta	1,048,248,285	48.01%
1ISP	VAGU	N	Alta	330,724,497	15.15%
1ISP	BBEU	*	Alta	267,812,662	12.27%
1ISP	JGHY	N	Alta	149,443,458	6.85%
1ISP	JPEM	*	Alta	145,775,342	6.68%
1ISP	BBJP	*	Alta	103,138,188	4.72%
1ISP	EMGA	N	Alta	42,021,267	1.93%
1ISP	BBAX	*	Alta	41,788,567	1.91%
1ISP	BBIL	N	Alta	5,063,279	0.23%
	Reportos			6,011,585	0.28%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	6,011,585	0.28%
	TOTAL CARTERA			2,183,217,705	100.00%
	ACTIVO NETO			2,187,117,161	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 3.000 % Var Promedio: 0.795 %

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."

