

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			24,815,608	0.89%
CHD	40-133	1648040		24,815,608	0.89%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,603,647,031	93.28%
1ISP	SPY	*	Alta	2,154,905,140	77.21%
1ISP	BBUS	*	Alta	322,316,342	11.55%
1ISP	BIL	*	Alta	126,425,548	4.53%
	Reportos			162,661,498	5.83%
LD	BONDES	250814	AAA(mex)	141,443,369	5.07%
LF	BONDES	290419	AAA(mex)	21,218,129	0.76%
	TOTAL CARTERA			2,791,124,137	100.00%
	ACTIVO NETO			2,788,575,090	

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 4.800 % Var Promedio: 0.979 %

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."