

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			422,231	16.49%
CHD	40-133	8019333		422,231	16.49%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			1,607,656	62.78%
1ISP	SHV	*	Alta	1,258,256	49.14%
1ISP	SPY	*	Alta	349,400	13.65%
	Reportos			530,756	20.73%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	530,756	20.73%
	TOTAL CARTERA			2,560,643	100.00%
	ACTIVO NETO			2,557,865	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.731 %

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."