

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			468,213	16.77%
CHD	40-133	8019333		468,213	16.77%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,784,932	63.93%
1ISP	SHV	*	Alta	1,382,611	49.52%
1ISP	SPY	*	Alta	402,321	14.41%
	Reportos			538,816	19.30%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	538,816	19.30%
	TOTAL CARTERA			2,791,961	100.00%
	ACTIVO NETO			2,783,555	
	Cartera al:	27/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.701 %

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."