

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			553,466	17.81%
CHD	40-133	8019333		553,466	17.81%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			1,993,437	64.14%
1ISP	SHV	*	Alta	1,517,561	48.83%
1ISP	SPY	*	Alta	475,876	15.31%
	Reportos			561,291	18.06%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	561,291	18.06%
	TOTAL CARTERA			3,108,194	100.00%
	ACTIVO NETO			3,083,734	
	Cartera al:	19/12/2024			

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.953 %

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."