

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			248,529	0.01%
CHD	40-133	8033359		248,529	0.01%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,353,240,968	99.93%
1ISP	BBUS	*	Alta	1,157,604,297	49.16%
1ISP	VAGU	N	Alta	365,890,193	15.54%
1ISP	BBEU	*	Alta	288,915,208	12.27%
1ISP	JGHY	N	Alta	164,912,207	7.00%
1ISP	JPEM	*	Alta	163,274,863	6.93%
1ISP	BBJP	*	Alta	112,969,201	4.80%
1ISP	EMGA	N	Alta	47,240,728	2.01%
1ISP	BBAX	*	Alta	46,920,415	1.99%
1ISP	BBIL	N	Alta	5,513,854	0.23%
	Reportos			1,333,131	0.06%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	1,333,131	0.06%
	TOTAL CARTERA			2,354,822,628	100.00%
	ACTIVO NETO			2,369,536,587	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 3.000 % Var Promedio: 0.809 %

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."