

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			209,965	1.84%
CHD	40-133	8153199		209,965	1.84%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			3,415,388	29.92%
IISP	SPY	*	Alta	3,415,388	29.92%
	Reportos			7,790,485	68.24%
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	7,790,485	68.24%
	TOTAL CARTERA			11,415,838	100.00%
	ACTIVO NETO			11,448,619	
	Cartera al:	09/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 4.130 % Var Promedio: 0.316 %
 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."