

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			212,174	21.87%
CHD	40-133	8153199		212,174	21.87%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			456,375	47.05%
IISP	SPY	*	Alta	456,375	47.05%
	Reportos			301,523	31.08%
LF	BONDESF	250313	AAA(mex)	301,523	31.08%
	TOTAL CARTERA			970,072	100.00%
	ACTIVO NETO			996,079	
	Cartera al:	31/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 4.130 % Var Promedio: 0.408 %
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."