

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			536,583	17.56%
CHD	40-133	8019333		536,583	17.56%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,962,073	64.22%
1ISP	SHV	*	Alta	1,488,754	48.73%
1ISP	SPY	*	Alta	473,319	15.49%
	Reportos			556,606	18.22%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	556,606	18.22%
	TOTAL CARTERA			3,055,262	100.00%
	ACTIVO NETO			3,028,948	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.954 %

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."