

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			423,025	16.46%
CHD	40-133	8019333		423,025	16.46%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,620,466	63.03%
1ISP	SHV	*	Alta	1,279,661	49.78%
1ISP	SPY	*	Alta	340,805	13.26%
	Reportos			527,381	20.51%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	527,381	20.51%
	TOTAL CARTERA			2,570,872	100.00%
	ACTIVO NETO			2,572,533	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 3.200 % Var Promedio: 0.719 %

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."