

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			510,542,000	94.87%
1B	ANGELD	10	Media	248,752,568	46.22%
1B	DIABLOI	10	Baja	178,323,325	33.14%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	82,545,725	15.34%
1B	SMARTRC	14	Minima	920,382	0.17%
	Reportos			27,609,859	5.13%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	27,609,859	5.13%
	TOTAL CARTERA			538,151,859	100.00%
	ACTIVO NETO			538,183,003	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.044 %
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."