

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			480,904,510	96.73%
1B	ANGELD	10	Media	282,890,971	56.90%
1B	DIABLOI	10	Media	185,651,397	37.34%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	11,327,000	2.28%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,035,142	0.21%
	Reportos			16,254,334	3.27%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	16,254,334	3.27%
	TOTAL CARTERA			497,158,844	100.00%
	ACTIVO NETO			497,266,402	

Cartera al: 16/01/2025

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.289 %
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."