

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones				514,984,729	95.08%
1B	DIABLOI	10	Media	247,791,189	45.75%
1B	ANGELD	10	Media	224,873,752	41.52%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	41,179,952	7.60%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,139,836	0.21%
Reportos				26,644,073	4.92%
BI	CETES	270318	AAA(mex)	26,644,073	4.92%
TOTAL CARTERA				541,628,802	100.00%
ACTIVO NETO				542,451,114	

Cartera al: 15/05/2025

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.724 %

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."