

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			466,544,789	93.93%
1B	ANGELD	10	Media	276,181,579	55.60%
1B	DIABLOI	10	Media	184,902,023	37.23%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	4,431,022	0.89%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,030,166	0.21%
	Reportos			30,176,206	6.08%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	30,176,206	6.08%
	TOTAL CARTERA			496,720,995	100.00%
	ACTIVO NETO			496,833,630	

Cartera al: 29/11/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.166 %
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."