

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			503,074,037	94.88%
1B	ANGELD	10	Media	239,937,611	45.25%
1B	DIABLOI	10	Baja	181,411,328	34.21%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	80,812,895	15.24%
1B	SMARTRC	14	Minima	912,203	0.17%
	Reportos			27,154,869	5.12%
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	27,154,869	5.12%
	TOTAL CARTERA			530,228,906	100.00%
	ACTIVO NETO			530,174,985	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.028 %
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."