

**DISCRECIONAL**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>493,438,446</b>	<b>95.90%</b>
1B	ANGELD	10	Baja	292,858,812	56.92%
1B	DIABLOI	10	Baja	192,093,522	37.33%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	7,580,882	1.47%
1B	SMARTRC	14	Minima	905,229	0.18%
	<b>Reportos</b>			<b>21,112,562</b>	<b>4.10%</b>
LF	BONDEF	321021	AAA(mex)	21,112,562	4.10%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>514,551,008</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>514,877,917</b>	

Cartera al: 18/07/2024

**Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.198 %**  
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."