

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones				517,119,363	94.93%
1B	DIABLOI	10	Media	244,200,834	44.83%
1B	ANGELD	10	Media	230,268,177	42.27%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	41,503,594	7.62%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,146,758	0.21%
Reportos				27,598,799	5.07%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	27,598,799	5.07%
TOTAL CARTERA				544,718,162	100.00%
ACTIVO NETO				545,747,651	

Cartera al: 29/05/2025

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.733 %

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."