

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			520,360,772	95.24%
1B	DIABLOI	10	Media	254,656,564	46.61%
1B	ANGELD	10	Media	206,856,532	37.86%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	57,694,115	10.56%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,153,560	0.21%
	Reportos			26,023,582	4.76%
BI	CETES	260401	AAA(mex)	26,023,582	4.76%
	TOTAL CARTERA			546,384,354	100.00%
	ACTIVO NETO			541,175,044	

Cartera al: 26/06/2025

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.590 %

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."