

**DISCRECIONAL**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>495,137,079</b>	<b>94.89%</b>
1B	ANGELD	10	Media	227,089,746	43.52%
1B	DIABLOI	10	Baja	188,442,239	36.11%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	78,693,400	15.08%
1B	SMARTRC	14	Minima	911,693	0.18%
	<b>Reportos</b>			<b>26,684,968</b>	<b>5.11%</b>
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	26,684,968	5.11%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>521,822,047</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>522,225,531</b>	

Cartera al: 31/05/2024

**Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.006 %**  
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."