

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			480,597,324	94.74%
1B	ANGELD	10	Media	257,213,024	50.71%
1B	DIABLOI	10	Baja	158,081,054	31.16%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	64,406,619	12.70%
1B	SMARTRC	14	Minima	896,626	0.18%
	Reportos			26,668,278	5.26%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	26,668,278	5.26%
	TOTAL CARTERA			507,265,602	100.00%
	ACTIVO NETO			506,969,886	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.884 %
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."