

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			486,974,238	95.45%
1B	ANGELD	10	Media	310,961,117	60.95%
1B	DIABLOI	10	Baja	170,507,235	33.42%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	4,488,566	0.88%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,017,319	0.20%
	Reportos			23,216,692	4.55%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	23,216,692	4.55%
	TOTAL CARTERA			510,190,930	100.00%
	ACTIVO NETO			509,899,811	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.268 %
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."