

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Acciones				499,683,929	97.15%
1B	DIABLOI	10	Baja	254,555,539	49.49%
1B	ANGELD	10	Media	215,991,220	41.99%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	28,067,935	5.46%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,069,235	0.21%
Reportos				14,675,830	2.85%
BI	CETES	250508	AAA(mex)	14,675,830	2.85%
TOTAL CARTERA				514,359,759	100.00%
ACTIVO NETO				514,686,410	
Cartera al:		28/02/2025			

Límite Máximo de VaR:

4.150 % Var Promedio: 0.684 %

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."