

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			497,930,901	94.95%
1B	ANGELD	10	Baja	233,364,298	44.50%
1B	DIABLOI	10	Baja	184,142,068	35.12%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	79,524,013	15.17%
1B	SMARTRC	14	Minima	900,522	0.17%
	Reportos			26,459,928	5.05%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	26,459,928	5.05%
	TOTAL CARTERA			524,390,829	100.00%
	ACTIVO NETO			524,376,844	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.016 %
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."