

## DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>504,722,461</b>	<b>94.91%</b>
1B	ANGELD	10	Baja	241,328,328	45.38%
1B	DIABLOI	10	Baja	181,481,967	34.13%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	81,042,030	15.24%
1B	SMARTRC	14	Minima	870,137	0.16%
	<b>Reportos</b>			<b>27,078,288</b>	<b>5.09%</b>
M	BONOS	421113	AAA(mex)	27,078,288	5.09%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>531,800,749</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>531,828,327</b>	

Cartera al: 11/04/2024

**Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.034 %**  
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."