

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			485,632,075	94.09%
1B	ANGELD	10	Media	303,724,247	58.85%
1B	DIABLOI	10	Media	176,249,609	34.15%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	4,612,187	0.89%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,046,032	0.20%
	Reportos			30,496,796	5.91%
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	30,496,796	5.91%
	TOTAL CARTERA			516,128,871	100.00%
	ACTIVO NETO			515,535,401	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.228 %
 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."