

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			507,198,239	95.02%
1B	ANGELD	10	Media	247,948,305	46.45%
1B	DIABLOI	10	Baja	176,707,636	33.10%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	81,700,792	15.31%
1B	SMARTRC	14	Minima	841,507	0.16%
	Reportos			26,590,683	4.98%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	26,590,683	4.98%
	TOTAL CARTERA			533,788,922	100.00%
	ACTIVO NETO			533,756,632	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.973 %
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."