

DISCRECIONAL

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|---|--------|------------|--------------------|----------------|
| | Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione | | | 495,137,079 | 94.89% |
| 1B | ANGELD | 10 | Media | 227,089,746 | 43.52% |
| 1B | DIABLOI | 10 | Baja | 188,442,239 | 36.11% |
| 1B | NAFTRAC | ISHRS | Alta | 78,693,400 | 15.08% |
| 1B | SMARTRC | 14 | Minima | 911,693 | 0.18% |
| | Reportos | | | 26,684,968 | 5.11% |
| LD | BONDESD | 250416 | AAA(mex) | 26,684,968 | 5.11% |
| | TOTAL CARTERA | | | 521,822,047 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 522,225,531 | |

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.006 %
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."