

DISCRECIONAL

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---|---------|--------|------------|--------------------|----------------|
| Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione | | | | 493,723,899 | 96.83% |
| 1B | DIABLOI | 10 | Media | 240,643,086 | 47.20% |
| 1B | ANGELD | 10 | Media | 230,811,970 | 45.27% |
| 1B | NAFTRAC | ISHRS | Alta | 21,215,123 | 4.16% |
| 1B | SMARTRC | 14 | Minima | 1,053,720 | 0.21% |
| Reportos | | | | 16,161,545 | 3.17% |
| LF | BONDESF | 261203 | AAA(mex) | 16,161,545 | 3.17% |
| TOTAL CARTERA | | | | 509,885,444 | 100.00% |
| ACTIVO NETO | | | | 509,541,450 | |

Cartera al: 31/01/2025

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.145 %
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."