

## DISCRECIONAL

| T.VALOR | EMISORA                                                         | SERIE  | CALIF/BURS | VALOR TOTAL        | %              |
|---------|-----------------------------------------------------------------|--------|------------|--------------------|----------------|
|         | <b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b> |        |            | <b>483,782,849</b> | <b>96.22%</b>  |
| 1B      | ANGELD                                                          | 10     | Media      | 295,735,476        | 58.82%         |
| 1B      | DIABLOI                                                         | 10     | Media      | 182,545,056        | 36.31%         |
| 1B      | NAFTRAC                                                         | ISHRS  | Alta       | 4,472,558          | 0.89%          |
| 1B      | SMARTRC                                                         | 14     | Minima     | 1,029,758          | 0.21%          |
|         | <b>Reportos</b>                                                 |        |            | <b>18,998,024</b>  | <b>3.78%</b>   |
| LF      | BONDESF                                                         | 261001 | AAA(mex)   | 18,998,024         | 3.78%          |
|         | <b>TOTAL CARTERA</b>                                            |        |            | <b>502,780,873</b> | <b>100.00%</b> |
|         | <b>ACTIVO NETO</b>                                              |        |            | <b>502,923,104</b> |                |

Cartera al: 31/10/2024

**Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 1.295 %**  
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."