

## DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione</b>			<b>487,650,773</b>	<b>93.33%</b>
1B	DIABLOI	10	Baja	245,419,618	46.97%
1B	ANGELD	10	Media	232,468,101	44.49%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	8,674,892	1.66%
1B	SMARTRC	14	Minima	1,088,162	0.21%
	<b>Reportos</b>			<b>34,840,072</b>	<b>6.67%</b>
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	34,840,072	6.67%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>522,490,845</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>522,926,064</b>	

Cartera al: 20/02/2025

**Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.702 %**  
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."