

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			385,886,524	80.46%
1	SPORT	S	Baja	100,798,474	21.02%
1	VINTE	*	Baja	69,306,005	14.45%
1	ACTINVR	B	Baja	63,710,146	13.28%
1	CEMEX	CPO	Alta	34,925,000	7.28%
1	ALTERNA	B	Baja	25,770,745	5.37%
1	HCITY	*	Media	23,878,245	4.98%
1	CADU	A	Baja	22,547,169	4.70%
1	BAFAR	B	Minima	19,890,000	4.15%
1	TRAXION	A	Alta	13,005,880	2.71%
1	AZTECA	CPO	Nula	5,910,987	1.23%
1	GICSA	B	Baja	5,106,139	1.07%
1	VASCONI	*	Minima	1,037,339	0.22%
1	SARE	B	Nula	395	0.00%
	Acciones de Aseguradoras Afianzadoras y Arrendadoras			6,194,358	1.29%
0	FINDEP	*	Baja	6,194,358	1.29%
	Fibras Certificados Inmobiliarios (CI)			87,162,104	18.17%
CF	FINN	13	Media	87,162,104	18.17%
	Chequera Dolares			14,667	0.00%
CHD	40-133	8037236		14,667	0.00%
	Reportos			354,228	0.07%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	354,228	0.07%
	TOTAL CARTERA			479,611,881	100.00%
	ACTIVO NETO			478,758,833	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 5.500 % Var Promedio: 0.782 %

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."