

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			2,194,082,000	31.74%
1	GMEXICO	B	Alta	2,098,740,000	30.36%
1	GMXT	*	Media	95,342,000	1.38%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			624,600,000	9.04%
CF	DANHOS	13	Media	624,600,000	9.04%
	Chequera Dolares			102	0.00%
CHD	40-133	8010662		102	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			3,384,454,216	48.96%
1ASP	BAC	*	Alta	991,764,397	14.35%
1ASP	META	*	Alta	829,487,702	12.00%
1ASP	MSFT	*	Alta	573,144,349	8.29%
1ASP	GOOG	*	Alta	522,342,292	7.56%
1ASP	DIS	*	Alta	467,715,476	6.77%
	Reportos			708,932,099	10.26%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	507,765,966	7.35%
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	201,166,133	2.91%
	TOTAL CARTERA			6,912,068,417	100.00%
	ACTIVO NETO			6,917,956,526	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.204 %

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."