

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			156,715,704	9.48%
1	CEMEX	CPO	Alta	82,214,160	4.97%
1	ARA	*	Media	74,501,544	4.51%
	Chequera Dolares			34	0.00%
CHD	40-133	8353344		34	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			1,489,927,387	90.14%
1ASP	MGA	N	Alta	192,752,808	11.66%
1ASP	ATSG	*	Alta	181,398,193	10.97%
1ASP	NTR	N	Alta	133,211,529	8.06%
1ASP	WBA	*	Alta	102,567,188	6.21%
1ASP	JACK	*	Alta	77,785,529	4.71%
1ASP	META	*	Alta	68,432,735	4.14%
1ASP	WBD	*	Alta	63,028,500	3.81%
1ASP	OI	*	Alta	60,426,181	3.66%
1ASP	ERJ	N	Alta	55,318,414	3.35%
1ASP	PARA	*	Alta	53,961,787	3.27%
1ASP	QCOM	*	Alta	52,487,233	3.18%
1ASP	GNRC	*	Alta	51,992,955	3.15%
1ASP	KSS	*	Alta	51,094,564	3.09%
1ASP	CVS	*	Alta	50,718,655	3.07%
1ASP	JWN	*	Alta	50,500,853	3.06%
1ASP	WHR	*	Alta	49,018,052	2.97%
1ASP	GT	*	Alta	47,455,529	2.87%
1ASP	GOOG	*	Alta	47,206,685	2.86%
1ASP	SHOP	N	Alta	44,945,583	2.72%
1ASP	JBLU	*	Alta	44,638,794	2.70%
1ASP	PYPL	*	Alta	10,985,619	0.67%
	Reportos			6,308,960	0.38%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	6,308,960	0.38%
	TOTAL CARTERA			1,652,952,085	100.00%
	ACTIVO NETO			1,654,366,730	

Cartera al:

20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 6.500 % Var Promedio: 1.837 %

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."