

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			1,475,525,627	59.26%
1	FEMSA	UBD	Alta	199,204,071	8.00%
1	GFNORTE	O	Alta	197,637,959	7.94%
1	AMX	B	Alta	160,683,878	6.45%
1	WALMEX	*	Alta	105,215,131	4.23%
1	BIMBO	A	Alta	101,930,099	4.09%
1	AC	*	Alta	93,156,897	3.74%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	91,524,663	3.68%
1	ORBIA	*	Alta	47,055,673	1.89%
1	ASUR	B	Alta	46,358,451	1.86%
1	CMOCTEZ	*	Media	45,035,447	1.81%
1	TLEVISA	CPO	Alta	34,199,163	1.37%
1	PINFRA	L	Media	32,067,763	1.29%
1	KOF	UBL	Alta	29,599,378	1.19%
1	GFINBUR	O	Alta	28,057,350	1.13%
1	ACTINVR	B	Baja	27,578,240	1.11%
1	ALFA	A	Alta	25,492,279	1.02%
1	BOLSA	A	Alta	24,608,028	0.99%
1	KIMBER	A	Alta	21,148,711	0.85%
1	NEMAK	A	Media	20,863,824	0.84%
1	CEMEX	CPO	Alta	17,708,843	0.71%
1	LASITE	B-1	Media	14,073,449	0.57%
1	GAP	B	Alta	13,976,845	0.56%
1	ALPEK	A	Media	13,962,326	0.56%
1	GCARSO	A1	Alta	13,922,662	0.56%
1	TRAXION	A	Alta	12,123,415	0.49%
1	HCITY	*	Media	9,533,374	0.38%
1	GICSA	B	Baja	7,986,129	0.32%
1	CULTIBA	B	Media	7,960,128	0.32%
1	CUERVO	*	Alta	6,450,920	0.26%
1	SITES1	A-1	Alta	6,420,610	0.26%
1	HOTEL	*	Baja	4,615,169	0.19%
1	AUTLAN	B	Media	4,007,447	0.16%
1	ARA	*	Media	3,077,847	0.12%
1	ALTERNA	B	Baja	2,265,774	0.09%

1	AGUA	*	Media	1,899,767	0.08%
1	MEDICA	B	Baja	1,659,593	0.07%
1	SORIANA	B	Media	1,299,658	0.05%
1	CTAXTEL	A	Media	1,164,665	0.05%
	Acciones Bancarias			39,772,109	1.60%
41	BBAJIO	O	Alta	39,772,109	1.60%
	Acciones de Aseguradoras Afianzadoras y Arrendadoras			2,781,264	0.11%
0	CREAL	*	Nula	2,781,264	0.11%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			89,386,753	3.59%
CF	FINN	13	Media	38,142,280	1.53%
CF	DANHOS	13	Media	36,365,586	1.46%
CF	FUNO	11	Alta	9,357,914	0.38%
CF	FSHOP	13	Media	5,520,972	0.22%
	Certificados Bursátiles Corporativos			57,231,142	2.30%
91	AMX	23-3	AAA (mex)	30,105,785	1.21%
91	GICSA	17	B/M	27,125,357	1.09%
	Chequera Dolares			108,986	0.00%
CHD	40-133	8038374		108,986	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			102,460,095	4.12%
1ASP	ABEV	N	Alta	23,690,726	0.95%
1ASP	BABA	N	Alta	23,492,691	0.94%
1ASP	TALO	*	Alta	10,746,801	0.43%
1ASP	VALE	N	Alta	8,296,163	0.33%
1ASP	PBR	N	Alta	7,206,419	0.29%
1ASP	WBA	*	Alta	6,122,370	0.25%
1ASP	KER	N	Alta	5,595,849	0.23%
1ASP	ULTA	*	Alta	4,866,005	0.20%
1ASP	ROG	N	Alta	3,607,130	0.15%
1ASP	CMCSA	*	Alta	3,476,636	0.14%
1ASP	RH	*	Alta	2,801,167	0.11%
1ASP	BAYN	N	Alta	2,558,139	0.10%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			390,550,677	15.69%
1ISP	TFRN	N	Alta	370,755,621	14.89%
1ISP	FXI	*	Alta	15,307,854	0.62%
1ISP	EWZ	*	Alta	4,487,203	0.18%
	Reportos			332,194,215	13.34%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	332,194,215	13.34%
	TOTAL CARTERA			2,490,010,868	100.00%

ACTIVO NETO

2,496,516,821

Cartera al:

20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 3.100 % Var Promedio: 0.637 %

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."