

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			2,307,286,000	34.52%
1	GMEXICO	B	Alta	2,202,480,000	32.95%
1	GMXT	*	Media	104,806,000	1.57%
	Fibras Certificados Inmobiliarios (CI)			633,300,000	9.48%
CF	DANHOS	13	Media	633,300,000	9.48%
	Chequera Dolares			94	0.00%
CHD	40-133	8010662		94	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			3,035,125,689	45.41%
1ASP	BAC	*	Alta	916,053,729	13.71%
1ASP	META	*	Alta	712,913,833	10.67%
1ASP	MSFT	*	Alta	493,080,621	7.38%
1ASP	GOOG	*	Alta	472,286,092	7.07%
1ASP	DIS	*	Alta	440,791,416	6.60%
	Reportos			708,041,285	10.59%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	708,041,285	10.59%
	TOTAL CARTERA			6,683,753,068	100.00%
	ACTIVO NETO			6,680,154,734	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % **Var Promedio:** 1.282 %

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."