

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			2,161,926,000	31.60%
1	GMEXICO	B	Alta	2,066,610,000	30.21%
1	GMXT	*	Media	95,316,000	1.39%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			593,700,000	8.68%
CF	DANHOS	13	Media	593,700,000	8.68%
	Chequera Dolares			101	0.00%
CHD	40-133	8010662		101	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			3,374,270,198	49.32%
1ASP	BAC	*	Alta	981,776,935	14.35%
1ASP	META	*	Alta	829,824,099	12.13%
1ASP	MSFT	*	Alta	572,111,196	8.36%
1ASP	GOOG	*	Alta	536,648,769	7.84%
1ASP	DIS	*	Alta	453,909,200	6.64%
	Reportos			711,326,988	10.40%
LF	BONDESF	270520	AAA(mex)	599,060,170	8.76%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	112,266,818	1.64%
	TOTAL CARTERA			6,841,223,287	100.00%
	ACTIVO NETO			6,846,338,259	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.210 %

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."