

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			2,202,128,000	30.94%
1	GMEXICO	B	Alta	2,116,380,000	29.74%
1	GMXT	*	Media	85,748,000	1.21%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			596,400,000	8.38%
CF	DANHOS	13	Media	596,400,000	8.38%
	Chequera Dolares			109	0.00%
CHD	40-133	8010662		109	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			3,549,299,546	49.87%
1ASP	BAC	*	Alta	1,083,894,784	15.23%
1ASP	META	*	Alta	924,409,308	12.99%
1ASP	MSFT	*	Alta	575,314,899	8.08%
1ASP	GOOG	*	Alta	520,498,048	7.31%
1ASP	DIS	*	Alta	445,182,507	6.26%
	Reportos			769,566,441	10.81%
IM	BPAG28	270204	AAA(mex)	603,516,344	8.48%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	166,050,097	2.33%
	TOTAL CARTERA			7,117,394,096	100.00%
	ACTIVO NETO			7,113,847,670	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.266 %

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."