

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			352,900,962	79.46%
1	SPORT	S	Baja	111,894,691	25.20%
1	VINTE	*	Baja	74,892,734	16.86%
1	ACTINVR	B	Baja	56,000,000	12.61%
1	CEMEX	CPO	Alta	26,178,500	5.90%
1	CADU	A	Baja	22,210,650	5.00%
1	BAFAR	B	Minima	18,718,149	4.22%
1	ALTERNA	B	Baja	15,822,425	3.56%
1	HCITY	*	Media	14,259,111	3.21%
1	TRAXION	A	Alta	5,980,000	1.35%
1	AZTECA	CPO	Nula	5,910,987	1.33%
1	VASCONI	*	Baja	747,953	0.17%
1	GICSA	B	Baja	285,369	0.06%
1	SARE	B	Nula	395	0.00%
	Acciones de Aseguradoras Afianzadoras y Arrendadoras			5,878,961	1.32%
0	FINDEP	*	Baja	5,878,961	1.32%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			84,006,136	18.92%
CF	FINN	13	Media	84,006,136	18.92%
	Chequera Dolares			14,592	0.00%
CHD	40-133	8037236		14,592	0.00%
	Reportos			1,304,091	0.29%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	1,304,091	0.29%
	TOTAL CARTERA			444,104,742	100.00%
	ACTIVO NETO			450,324,107	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 5.500 % Var Promedio: 0.829 %

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."