

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			1,567,093,716	94.24%
1	GFNORTE	O	Alta	204,617,160	12.31%
1	FEMSA	UBD	Alta	173,432,410	10.43%
1	GMEXICO	B	Alta	155,641,920	9.36%
1	WALMEX	*	Alta	153,000,315	9.20%
1	AMX	B	Alta	145,010,036	8.72%
1	CEMEX	CPO	Alta	143,439,025	8.63%
1	ASUR	B	Alta	83,301,760	5.01%
1	GAP	B	Alta	81,467,496	4.90%
1	AC	*	Alta	67,822,214	4.08%
1	TRAXION	A	Alta	56,246,624	3.38%
1	KIMBER	A	Alta	53,313,820	3.21%
1	GENTERA	*	Alta	53,090,127	3.19%
1	GCC	*	Alta	49,098,915	2.95%
1	VESTA	*	Alta	38,008,880	2.29%
1	ALSEA	*	Alta	31,781,664	1.91%
1	KOF	UBL	Alta	19,804,106	1.19%
1	VOLAR	A	Alta	17,044,920	1.03%
1	R	A	Alta	9,577,715	0.58%
1	OMA	B	Alta	8,452,160	0.51%
1	ACTINVR	B	Baja	8,285,120	0.50%
1	BIMBO	A	Alta	7,527,456	0.45%
1	CADU	A	Baja	3,576,008	0.22%
1	SPORT	S	Baja	1,610,955	0.10%
1	LAB	B	Alta	1,120,256	0.07%
1	ALTERNA	B	Baja	822,653	0.05%
	Fibras Certificados Inmobiliarios (CI)			46,866,769	2.82%
CF	FIBRAMQ	12	Alta	18,210,456	1.10%
CF	TERRA	13	Alta	12,144,830	0.73%
CF	FMTY	14	Media	10,686,572	0.64%
CF	FUNO	11	Alta	5,824,910	0.35%
	Chequera Dolares			2,161,655	0.13%
CHD	40-133	8075467		2,161,655	0.13%

	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			10,162,367	0.61%
1ASP	TX	*	Alta	10,162,367	0.61%
	Reportos			36,646,670	2.20%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	36,646,670	2.20%
	TOTAL CARTERA			1,662,931,177	100.00%
	ACTIVO NETO			1,652,623,838	
	Cartera al:	31/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.521 %
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."