

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			2,279,588,000	34.80%
1	GMEXICO	B	Alta	2,182,530,000	33.32%
1	GMXT	*	Media	97,058,000	1.48%
	Fibras Certificados Inmobiliarios (CI)			627,600,000	9.58%
CF	DANHOS	13	Media	627,600,000	9.58%
	Chequera Dolares			93	0.00%
CHD	40-133	8010662		93	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			2,976,169,291	45.43%
1ASP	BAC	*	Alta	867,807,983	13.25%
1ASP	META	*	Alta	718,518,410	10.97%
1ASP	MSFT	*	Alta	484,674,738	7.40%
1ASP	GOOG	*	Alta	461,003,889	7.04%
1ASP	DIS	*	Alta	444,164,270	6.78%
	Reportos			667,725,821	10.19%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	667,725,821	10.19%
	TOTAL CARTERA			6,551,083,205	100.00%
	ACTIVO NETO			6,561,599,944	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.343 %

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."