

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			2,112,262,000	30.78%
1	GMEXICO	B	Alta	2,017,050,000	29.39%
1	GMXT	*	Media	95,212,000	1.39%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			599,100,000	8.73%
CF	DANHOS	13	Media	599,100,000	8.73%
	Chequera Dolares			102	0.00%
CHD	40-133	8010662		102	0.00%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			3,440,374,610	50.13%
1ASP	BAC	*	Alta	975,436,290	14.21%
1ASP	META	*	Alta	860,802,852	12.54%
1ASP	MSFT	*	Alta	583,549,756	8.50%
1ASP	GOOG	*	Alta	550,378,939	8.02%
1ASP	DIS	*	Alta	470,206,774	6.85%
	Reportos			710,671,373	10.36%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	710,671,373	10.36%
	TOTAL CARTERA			6,862,408,085	100.00%
	ACTIVO NETO			6,867,684,261	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.208 %

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."