

DISCRECIONAL

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|---|---------|------------|----------------------|---------------|
| | Acciones Industriales Comerciales y de Servicios | | | 1,490,326,649 | 96.06% |
| 1 | GFNORTE | O | Alta | 182,472,840 | 11.76% |
| 1 | FEMSA | UBD | Alta | 163,754,615 | 10.55% |
| 1 | WALMEX | * | Alta | 161,278,775 | 10.40% |
| 1 | AMX | B | Alta | 147,808,997 | 9.53% |
| 1 | GMEXICO | B | Alta | 139,416,575 | 8.99% |
| 1 | CEMEX | CPO | Alta | 129,469,875 | 8.35% |
| 1 | GAP | B | Alta | 83,603,048 | 5.39% |
| 1 | ASUR | B | Alta | 83,168,168 | 5.36% |
| 1 | AC | * | Alta | 73,848,281 | 4.76% |
| 1 | GENTERA | * | Alta | 54,494,187 | 3.51% |
| 1 | TRAXION | A | Alta | 52,618,012 | 3.39% |
| 1 | GCC | * | Alta | 50,654,000 | 3.27% |
| 1 | VESTA | * | Alta | 38,631,605 | 2.49% |
| 1 | ALSEA | * | Alta | 33,763,134 | 2.18% |
| 1 | KOF | UBL | Alta | 19,356,650 | 1.25% |
| 1 | LAB | B | Alta | 17,674,740 | 1.14% |
| 1 | VOLAR | A | Alta | 14,869,680 | 0.96% |
| 1 | BIMBO | A | Alta | 11,267,799 | 0.73% |
| 1 | KIMBER | A | Alta | 9,495,000 | 0.61% |
| 1 | R | A | Alta | 8,728,645 | 0.56% |
| 1 | ACTINVR | B | Baja | 8,285,120 | 0.53% |
| 1 | CADU | A | Baja | 3,236,679 | 0.21% |
| 1 | SPORT | S | Baja | 1,607,571 | 0.10% |
| 1 | ALTERNA | B | Baja | 822,653 | 0.05% |
| | Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI) | | | 45,410,100 | 2.93% |
| CF | FIBRAMQ | 12 | Alta | 20,490,226 | 1.32% |
| CF | FMTY | 14 | Alta | 13,237,660 | 0.85% |
| CF | TERRA | 13 | Alta | 11,682,214 | 0.75% |
| | Chequera Dolares | | | 44,134 | 0.00% |
| CHD | 40-133 | 8075467 | | 44,134 | 0.00% |
| | Acciones Cotizadas en el SIC (Spot) | | | 9,521,258 | 0.61% |

| | | | | | |
|------|----------------------|--------|----------|----------------------|----------------|
| 1ASP | TX | * | Alta | 9,521,258 | 0.61% |
| | Reportos | | | 6,238,182 | 0.40% |
| IS | BPA182 | 260219 | AAA(mex) | 6,238,182 | 0.40% |
| | TOTAL CARTERA | | | 1,551,540,323 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 1,563,863,898 | |

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.520 %
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."