

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			1,695,766,971	93.21%
1	GFNORTE	O	Alta	236,335,800	12.99%
1	FEMSA	UBD	Alta	213,267,960	11.72%
1	WALMEX	*	Alta	165,389,500	9.09%
1	CEMEX	CPO	Alta	159,756,300	8.78%
1	AMX	B	Alta	147,671,306	8.12%
1	GMEXICO	B	Alta	137,529,195	7.56%
1	ASUR	B	Alta	81,380,672	4.47%
1	GAP	B	Alta	64,669,822	3.56%
1	TRAXION	A	Alta	62,336,159	3.43%
1	AC	*	Alta	62,037,755	3.41%
1	GENTERA	*	Alta	60,138,634	3.31%
1	KIMBER	A	Alta	59,366,800	3.26%
1	GCC	*	Alta	52,959,480	2.91%
1	BIMBO	A	Alta	46,596,977	2.56%
1	VESTA	*	Alta	40,965,405	2.25%
1	ALSEA	*	Alta	35,923,636	1.98%
1	VOLAR	A	Alta	16,595,380	0.91%
1	R	A	Alta	12,606,258	0.69%
1	ORBIA	*	Alta	12,294,420	0.68%
1	ACTINVR	B	Baja	7,715,518	0.42%
1	OMA	B	Alta	7,320,768	0.40%
1	CADU	A	Baja	4,099,658	0.23%
1	NEMAK	A	Media	3,635,450	0.20%
1	CUERVO	*	Alta	2,699,273	0.15%
1	SPORT	S	Baja	1,630,962	0.09%
1	ALTERNA	B	Baja	843,883	0.05%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			57,628,800	3.17%
CF	TERRA	13	Alta	20,728,451	1.14%
CF	FIBRAMQ	12	Alta	19,586,207	1.08%
CF	FMTY	14	Media	10,052,712	0.55%
CF	FUNO	11	Alta	7,261,430	0.40%
	Chequera Dolares			2,109,602	0.12%

CHD	40-133	8075467		2,109,602	0.12%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			6,847,837	0.38%
1ASP	TX	*	Alta	6,847,837	0.38%
	Reportos			56,857,526	3.13%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	56,857,526	3.13%
	TOTAL CARTERA			1,819,210,736	100.00%
	ACTIVO NETO			1,821,024,743	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 4.000 % Var Promedio: 1.447 %
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."