

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			406,126,338	81.39%
1	SPORT	S	Baja	106,727,796	21.39%
1	VINTE	*	Baja	68,916,178	13.81%
1	ACTINVR	B	Baja	63,624,743	12.75%
1	CEMEX	CPO	Alta	39,278,925	7.87%
1	HCITY	*	Media	27,855,692	5.58%
1	ALTERNA	B	Baja	25,770,745	5.17%
1	CADU	A	Baja	25,433,642	5.10%
1	BAFAR	B	Baja	20,400,000	4.09%
1	TRAXION	A	Alta	15,436,912	3.09%
1	AZTECA	CPO	Nula	5,910,987	1.19%
1	GICSA	B	Baja	5,630,585	1.13%
1	VASCONI	*	Minima	1,139,738	0.23%
1	SARE	B	Nula	395	0.00%
	Acciones de Aseguradoras Afianzadoras y Arrendadoras			6,194,358	1.24%
0	FINDEP	*	Baja	6,194,358	1.24%
	Fibras Certificadas Inmobiliarios (CI)			86,190,556	17.27%
CF	FINN	13	Media	86,190,556	17.27%
	Chequera Dolares			14,243	0.00%
CHD	40-133	8037236		14,243	0.00%
	Reportos			446,596	0.09%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	446,596	0.09%
	TOTAL CARTERA			498,972,091	100.00%
	ACTIVO NETO			498,628,425	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 5.500 % Var Promedio: 0.788 %

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."