

FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE
 ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	GFNORTE	O	ALTA	446,446,616	12.38%
1	FEMSA	UBD	ALTA	371,013,364	10.29%
1	WALMEX	*	ALTA	324,951,608	9.01%
1	AMX	B	ALTA	320,059,644	8.87%
1	GMEXICO	B	ALTA	296,520,599	8.22%
1	CEMEX	CPO	ALTA	249,418,915	6.91%
1	ASUR	B	ALTA	137,751,469	3.82%
1	AC	*	ALTA	110,776,495	3.07%
1	GRUMA	B	ALTA	99,911,892	2.77%
1	BIMBO	A	ALTA	98,259,663	2.72%
1	GAP	B	ALTA	93,230,547	2.58%
1	KOF	UBL	ALTA	73,670,713	2.04%
1				783,922,658	21.73%
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	72,527,950	2.01%
				3,478,462,133	96.43%
OTROS VALORES					
				128,652,226	3.57%
				128,652,226	3.57%
TOTAL CARTERA				3,607,114,359	100.00%
ACTIVO NETO				3,600,190,336	
VAR ESTABLECIDO \$				172,879,040	4.80%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				53,429,578	1.51%
Cartera al:			27-Mar-24		

Para determinar el valor máximo de VaR de mercado, se considera la totalidad de la composición de la cartera y se estresa en los máximos permitidos, utilizando la metodología histórica donde se calcula el vigésimo quinto escenario con mayor exposición al riesgo tomando como base un periodo de muestra de 500 días anteriores (que representan el percentil 5 de la serie).