

**FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE  
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>					
1	GFNORTE	O	ALTA	52,268,308	11.07%
1	FEMSA	UBD	ALTA	47,339,665	10.03%
1	GMEXICO	B	ALTA	39,340,317	8.33%
1	WALMEX	*	ALTA	38,502,287	8.16%
1	AMX	B	ALTA	38,147,661	8.08%
1	CEMEX	CPO	ALTA	31,718,902	6.72%
1	BIMBO	A	ALTA	17,160,055	3.64%
1	GAP	B	ALTA	15,420,896	3.27%
1	ASUR	B	ALTA	14,085,883	2.98%
1	AC	*	ALTA	12,143,178	2.57%
1				132,509,708	28.07%
<b>TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES</b>					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	22,049,312	4.67%
				<b>460,686,171</b>	<b>97.60%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>11,323,600</b>	<b>2.40%</b>
				<b>11,323,600</b>	<b>2.40%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>472,009,770</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>471,657,332</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>13,216,438</b>	<b>2.80%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>7,155,232</b>	<b>1.56%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>27-Mar-24</b>		

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). El límite autorizado del VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 2.80% con una probabilidad del 95%.