

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	FEMSA	UBD	ALTA	338,580,606	9.99%
1	AMX	B	ALTA	308,435,074	9.10%
1	GFNORTE	O	ALTA	308,219,222	9.10%
1	WALMEX	*	ALTA	267,696,086	7.90%
1	GMEXICO	B	ALTA	264,117,881	7.80%
1	CEMEX	CPO	ALTA	203,228,888	6.00%
1	ASUR	B	ALTA	135,445,000	4.00%
1	AC	*	ALTA	117,515,941	3.47%
1	GAP	B	ALTA	113,253,799	3.34%
1	GRUMA	B	ALTA	92,221,706	2.72%
1	BIMBO	A	ALTA	79,712,485	2.35%
1	KOF	UBL	ALTA	69,248,737	2.04%
1	KIMBER	A	ALTA	68,745,598	2.03%
1				676,283,730	19.96%
<b>TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES</b>					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	192,356,702	5.68%
				<b>3,235,061,456</b>	<b>95.49%</b>
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	95,665,987	2.82%
				<b>95,665,987</b>	<b>2.82%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>57,167,368</b>	<b>1.69%</b>
				<b>57,167,368</b>	<b>1.69%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,387,894,811</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,390,107,409</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>162,748,831</b>	<b>4.80%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>18,629,418</b>	<b>0.55%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>13-Jun-24</b>		

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).