

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	337,876,803	10.05%
1	GFNORTE	O	ALTA	307,616,966	9.15%
1	AMX	B	ALTA	292,398,574	8.70%
1	WALMEX	*	ALTA	273,404,828	8.14%
1	GMEXICO	B	ALTA	266,143,153	7.92%
1	CEMEX	CPO	ALTA	211,407,082	6.29%
1	ASUR	B	ALTA	132,015,193	3.93%
1	AC	*	ALTA	113,259,201	3.37%
1	GAP	B	ALTA	105,141,673	3.13%
1	GRUMA	B	ALTA	87,291,426	2.60%
1	BIMBO	A	ALTA	83,904,161	2.50%
1	KOF	UBL	ALTA	68,562,543	2.04%
1				770,970,523	22.94%
<b>TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES</b>					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	150,905,962	4.49%
				<b>3,200,898,090</b>	<b>95.25%</b>
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	99,996,774	2.98%
				<b>99,996,774</b>	<b>2.98%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>59,648,078</b>	<b>1.77%</b>
				<b>59,648,078</b>	<b>1.77%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>3,360,542,942</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>3,360,109,008</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>161,330,269</b>	<b>4.80%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>47,748,459</b>	<b>1.40%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>28-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).