

**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	FEMSA	UBD	ALTA	41,884,637	9.49%
1	GFNORTE	O	ALTA	40,088,727	9.09%
1	AMX	B	ALTA	38,123,176	8.64%
1	WALMEX	*	ALTA	35,778,394	8.11%
1	GMEXICO	B	ALTA	35,748,909	8.10%
1	CEMEX	CPO	ALTA	27,978,949	6.34%
1	GAP	B	ALTA	16,528,040	3.75%
1	ASUR	B	ALTA	15,647,126	3.55%
1	BIMBO	A	ALTA	14,129,109	3.20%
1	AC	*	ALTA	12,509,003	2.83%
1	KOF	UBL	ALTA	9,166,385	2.08%
1	GRUMA	B	ALTA	9,048,046	2.05%
1				104,798,508	23.75%
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	24,116,502	5.47%
				425,545,510	96.44%
REPORTO					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	9,384,009	2.13%
				9,384,009	2.13%
OTROS VALORES					
				6,302,883	1.43%
				6,302,883	1.43%
TOTAL CARTERA				441,232,403	100.00%
ACTIVO NETO				440,777,398	
VAR ESTABLECIDO \$				12,352,569	2.80%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				6,383,271	1.44%
Cartera al:			28-Jun-24		

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%.