

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	452,533,847	13.13%
1	GFNORTE	O	ALTA	447,775,366	13.00%
1	WALMEX	*	ALTA	324,163,652	9.41%
1	AMX	B	ALTA	312,578,712	9.07%
1	GMEXICO	B	ALTA	271,060,683	7.87%
1	CEMEX	CPO	ALTA	212,739,648	6.17%
1	ASUR	B	ALTA	130,829,945	3.80%
1	AC	*	ALTA	119,540,233	3.47%
1	BIMBO	A	ALTA	102,773,452	2.98%
1	GRUMA	B	ALTA	94,138,707	2.73%
1	GAP	B	ALTA	92,920,803	2.70%
1				730,542,423	21.20%
				3,291,597,472	95.54%
OTROS VALORES				153,677,897	4.46%
				153,677,897	4.46%
TOTAL CARTERA				3,445,275,369	100.00%
ACTIVO NETO				3,438,789,404	
VAR ESTABLECIDO \$				165,090,093	4.80%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				21,633,339	0.63%
Cartera al:			25-Jan-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).