

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	AMX	B	ALTA	315,374,985	8.42%
1	GFNORTE	O	ALTA	315,131,739	8.42%
1	GMEXICO	B	ALTA	303,961,563	8.12%
1	FEMSA	UBD	ALTA	299,806,613	8.01%
1	WALMEX	*	ALTA	280,881,254	7.50%
1	CEMEX	CPO	ALTA	271,538,068	7.25%
1	GAP	B	ALTA	177,456,701	4.74%
1	ASUR	B	ALTA	145,840,412	3.89%
1	AC	*	ALTA	141,670,983	3.78%
1	BIMBO	A	ALTA	97,231,146	2.60%
1	GRUMA	B	ALTA	93,406,889	2.49%
1	KOF	UBL	ALTA	92,672,474	2.48%
1				826,046,372	22.06%
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES					
1B	NAFRAC	ISHRS	ALTA	255,146,716	6.81%
				3,616,165,916	96.58%
OTROS VALORES					
				128,207,314	3.42%
				128,207,314	3.42%
TOTAL CARTERA				3,744,373,230	100.00%
ACTIVO NETO				3,743,302,387	
VAR ESTABLECIDO \$				179,724,926	4.80%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				52,413,891	1.39%
Cartera al:			29-Nov-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).