

**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	GFNORTE	O	ALTA	314,356,944	8.13%
1	GMEXICO	B	ALTA	308,360,280	7.97%
1	WALMEX	*	ALTA	302,403,325	7.82%
1	AMX	B	ALTA	301,482,727	7.80%
1	FEMSA	UBD	ALTA	297,485,738	7.69%
1	CEMEX	CPO	ALTA	276,413,078	7.15%
1	GAP	B	ALTA	183,994,052	4.76%
1	ASUR	B	ALTA	150,186,770	3.88%
1	AC	*	ALTA	142,939,138	3.70%
1	BIMBO	A	ALTA	100,954,885	2.61%
1	KOF	UBL	ALTA	92,005,021	2.38%
1	GRUMA	B	ALTA	89,775,783	2.32%
1				773,052,184	19.99%
<b>TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES</b>					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	361,921,799	9.36%
				<b>3,695,331,724</b>	<b>95.55%</b>
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	113,280,922	2.93%
				<b>113,280,922</b>	<b>2.93%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>58,776,824</b>	<b>1.52%</b>
				<b>58,776,824</b>	<b>1.52%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>3,867,389,470</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>3,869,133,821</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>185,746,840</b>	<b>4.80%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>27,647,859</b>	<b>0.72%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>19-Dec-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).