

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			27,643,071	74.13%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	25,643,177	68.77%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,999,893	5.36%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			159	0.00%
1B	IVPESO	ISHRS	Media	105	0.00%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	53	0.00%
	Chequera Dolares			386	0.00%
CHD	40-133	8150906		386	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión			70	0.00%
52	MAYA	FF		60	0.00%
52	ACTI500	FF		11	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			3,443	0.01%
51	ACTIGOB	FF	HR AAA	3,417	0.01%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	26	0.00%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			4,521,742	12.13%
1ISP	RSP	*	Alta	4,517,322	12.11%
1ISP	IWM	*	Alta	3,918	0.01%
1ISP	DOG	*	Alta	502	0.00%
	Reportos			5,121,796	13.74%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,121,796	13.74%
	TOTAL CARTERA			37,290,667	100.00%
	ACTIVO NETO			37,315,939	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 2.250 % Var Promedio: 0.161 %

Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."

Para conocer la posición indirecta de los fondos subyacentes, consultar las siguientes liga:

<https://www.actinver.com/web/actinver/todos-los-fondos>