

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			18,574,561	70.62%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	18,493,040	70.31%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	81,521	0.31%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Ac			2,276,484	8.66%
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	2,276,484	8.66%
	Acciones de Fondos de Inversión			60	0.00%
52	MAYA	FF		60	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos d			223,799	0.85%
51	ACTIGOB	FF	HR AAA	223,771	0.85%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	28	0.00%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			2,223,262	8.45%
1ISP	DOG	*	Alta	2,219,828	8.44%
1ISP	RSP	*	Alta	3,434	0.01%
	Reportos			3,003,255	11.42%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	3,003,255	11.42%
	TOTAL CARTERA			26,301,421	100.00%
	ACTIVO NETO			26,376,666	
	Cartera al:	19/09/2024			

Límite Máximo de VaR: 2.500 % Var Promedio: 0.400 %

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>