

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			15,273,478	58.68%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	15,273,478	58.68%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			5,811,191	22.33%
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	5,811,191	22.33%
	Acciones de Fondos de Inversión			59	0.00%
52	MAYA	FF		59	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			1,023,046	3.93%
51	ACTIGOB	FF	HR AAA	1,023,019	3.93%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	27	0.00%
	Reportos			3,922,520	15.07%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	3,922,520	15.07%
	TOTAL CARTERA			26,030,294	100.00%
	ACTIVO NETO			26,179,068	
	Cartera al:		20/06/2024		

Límite Máximo de VaR: 2.700 % Var Promedio: 0.314 %

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>