

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			17,404,259	66.21%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	14,404,319	54.80%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,999,941	11.41%
	Acciones de Fondos de Inversión			60	0.00%
52	MAYA	FF		60	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			34	0.00%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	26	0.00%
51	ACTIGOB	FF	HR AAA	8	0.00%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			6,026,145	22.92%
1ISP	RSP	*	Alta	6,026,145	22.92%
	Reportos			2,856,790	10.87%
LF	BONDESF	321021	AAA(mex)	2,856,790	10.87%
	TOTAL CARTERA			26,287,288	100.00%
	ACTIVO NETO			26,829,654	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 2.700 % Var Promedio: 0.292 %

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>