

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			172,108	0.01%
CHD	40-133	1648040		172,108	0.01%
	Acciones de Fondos de Inversión			560,953,931	38.87%
52	ACTI500	FF		560,953,931	38.87%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			603,112,253	41.79%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	603,112,253	41.79%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			78,402,047	5.43%
1ISP	SPY	*	Alta	60,292,309	4.18%
1ISP	BBUS	*	Alta	18,109,737	1.26%
	Reportos			200,502,524	13.89%
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	200,502,524	13.89%
	TOTAL CARTERA			1,443,142,863	100.00%
	ACTIVO NETO			1,441,507,524	
	Cartera al:	20/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 3.800 % Var Promedio: 0.582 %
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>