

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			4,256,370	0.32%
CHD	40-133	1648040		4,256,370	0.32%
	Acciones de Fondos de Inversión			499,441,922	38.01%
52	ACTI500	FF		499,441,922	38.01%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			650,880,336	49.53%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	650,880,336	49.53%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			158,312,101	12.05%
1ISP	SPY	*	Alta	104,697,680	7.97%
1ISP	SHV	*	Alta	37,503,116	2.85%
1ISP	BBUS	*	Alta	16,111,306	1.23%
	Reportos			1,129,250	0.09%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	1,129,250	0.09%
	TOTAL CARTERA			1,314,019,979	100.00%
	ACTIVO NETO			1,313,442,532	
	Cartera al:	31/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 3.800 % Var Promedio: 0.605 %

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>