

DISCRECIONAL					
T.Valor	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,468,427,662	53.32%
BI	CETES	261015	AAA(mex)	1,318,645,404	47.88%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	149,782,258	5.44%
	Chequera Dolares			108,741,955	3.95%
CHD	40-110	8099562		92,271,257	3.35%
CHD	40-133	1648040		16,470,698	0.60%
	Forward de Divisas			-44,208,549	-1.61%
FWD	MXPUSD	251024		-11,282,964	-0.41%
FWD	MXPUSD	251024		-9,149,063	-0.33%
FWD	MXPUSD	251024		-5,389,040	-0.20%
FWD	MXPUSD	251024		-7,304,536	-0.27%
FWD	MXPUSD	251024		-4,817,701	-0.18%
FWD	MXPUSD	251024		-3,844,400	-0.14%
FWD	MXPUSD	251024		-2,942,915	-0.11%
FWD	MXPUSD	261014		522,070	0.02%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda			219,488,848	7.97%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	219,488,848	7.97%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			924,953,361	33.59%
1ISP	SHY	*	Alta	609,609,667	22.14%
1ISP	SPXL	*	Alta	315,343,694	11.45%
	Reportos			76,442,106	2.78%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	76,442,106	2.78%
	TOTAL CARTERA			2,753,845,383	100.00%
	ACTIVO NETO			2,793,771,682	

Límite Máximo de VaR:

4.800 % Var Promedio: 0.703 %

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 la siguiente liga:

<https://www.actinver.com/web/actinver/todos-los-fondos>