

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			4,325,591	12.25%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	4,325,591	12.25%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			156	0.00%
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	99	0.00%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	57	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			24,696,048	69.96%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	24,696,048	69.96%
	Chequera Dolares			356	0.00%
CHD	40-133	8150906		356	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión			74	0.00%
52	MAYA	FF		64	0.00%
52	ACTI500	FF		9	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			31	0.00%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	24	0.00%
51	ACTIGOB	FF	HR AAA	7	0.00%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			3,953,555	11.20%
1ISP	IVV	*	Alta	3,953,086	11.20%
1ISP	DOG	*	Alta	469	0.00%
	Reportos			2,325,649	6.59%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	2,325,649	6.59%
	TOTAL CARTERA			35,301,460	100.00%
	ACTIVO NETO			35,354,435	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 2.250 % Var Promedio: 0.188 %

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>