

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			7,205,268	29.07%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	7,205,268	29.07%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			10,382,421	41.89%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	10,382,421	41.89%
	Acciones de Fondos de Inversión			64	0.00%
52	MAYA	FF		64	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%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			5,285,293	21.32%
1ISP	IVV	*	Alta	5,285,293	21.32%
	Reportos			1,912,627	7.72%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	1,912,627	7.72%
	TOTAL CARTERA			24,785,704	100.00%
	ACTIVO NETO			24,865,342	
	Cartera al:	27/03/2024			

Límite Máximo de VaR: 2.700 % Var Promedio: 0.397 %

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>