

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			40,002,615	47.56%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	40,002,615	47.56%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			42,700,870	50.77%
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	42,700,870	50.77%
	Acciones de Fondos de Inversión			60	0.00%
52	MAYA	FF		60	0.00%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu			8	0.00%
51	ACTIGOB	FF	HR AAA	8	0.00%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			12,711	0.02%
1ISP	IVV	*	Alta	12,179	0.01%
1ISP	DOG	*	Alta	533	0.00%
	Reportos			1,397,246	1.66%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	1,397,246	1.66%
	TOTAL CARTERA			84,113,510	100.00%
	ACTIVO NETO			92,374,938	
	Cartera al:		14/11/2024		

Límite Máximo de VaR: 3.700 % Var Promedio: 0.578 %

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>