

ACTICOB

ACTICOBER S.A DE C.V FONDO DE INVERSION
EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|--|---------|------------|-----------------------|----------------|
| | Chequera Dólares | | | 3,727,561,308 | 24.76% |
| CHD | 40-110 | 9730399 | | 3,722,713,885 | 24.73% |
| CHD | 40-133 | 8009722 | | 4,847,424 | 0.03% |
| | Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín) | | | 1,412,461 | 0.01% |
| EAIM | RJOBRIE | 9510018 | | 1,412,461 | 0.01% |
| | Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot) | | | 43,516,475 | 0.29% |
| D7SP | ARBA944 | 260812 | A+ | 43,516,475 | 0.29% |
| | Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot) | | | 9,632,427,817 | 63.99% |
| D4SP | TBILM07 | 260423 | AA+ | 2,325,040,127 | 15.45% |
| D4SP | TBILF64 | 260709 | AA+ | 1,774,546,940 | 11.79% |
| D4SP | TBILD26 | 260416 | AA+ | 1,610,792,747 | 10.70% |
| D4SP | TBILH03 | 260414 | AA+ | 895,069,910 | 5.95% |
| D4SP | TBILJ68 | 260421 | AA+ | 894,429,407 | 5.94% |
| D4SP | TBILN89 | 260430 | AA+ | 893,607,348 | 5.94% |
| D4SP | TBILX89 | 260611 | AA+ | 889,815,954 | 5.91% |
| D4SP | TBILC16 | 261224 | AA+ | 349,125,385 | 2.32% |
| | Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot) | | | 88,805,659 | 0.59% |
| D5SP | TNOTB28 | 270731 | AA+ | 88,805,659 | 0.59% |
| | Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot) | | | 1,548,166,586 | 10.28% |
| 1ISP | SHV | * | | 677,706,481 | 4.50% |
| 1ISP | IB01 | N | | 429,559,493 | 2.85% |
| 1ISP | AFLT | N | | 312,199,928 | 2.07% |
| 1ISP | SHY | * | | 128,700,684 | 0.86% |
| | Reportos | | | 11,602,138 | 0.08% |
| IS | BPA182 | 310327 | AAA(mex) | 11,602,138 | 0.08% |
| | TOTAL CARTERA | | | 15,053,492,444 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 15,125,352,429 | |

Cartera al:

31/03/2026

Límite Máximo de VaR:

1.425 % Var Promedio: 0.870 %

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."
