

Actinver | ACTICOB

Acticober, S.A. de C.V.

Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

SOCIEDAD DE CORTO PLAZO ESPECIALIZADA EN COBERTURA

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				6,918,440,357	58.88%
FSP	HSBCMX	D19004	F1+(mex)	4,895,004,150	41.66%
FSP	HSBCMX	D19014	F1+(mex)	979,961,895	8.34%
FSP	HSBCMX	D19013	F1+(mex)	978,792,169	8.33%
FSP	HSBCMX	D19015	F1+(mex)	64,682,143	0.55%
Chequera Dolares				767,171,538	6.53%
CHD	40-133	8009722		767,171,538	6.53%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				314,611,829	2.68%
D2SP	CSP19	231214	Baa2	154,240,990	1.31%
D2SP	MSM03	210210	BBB+	98,264,214	0.84%
D2SP	GMC83	201106	BBB	58,742,422	0.50%
D2SP	ARBA722	210630	A+	3,364,202	0.03%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,541,870	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,541,870	0.01%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				978,265,882	8.33%
D4SP	TBILN16	191205	AA+	978,265,882	8.33%
Certificados Bursátiles Bancarios Spot				2,595,456,710	22.09%
94SP	HSBC	18D	AAA(mex)	1,539,628,489	13.10%
94SP	HSBC	19D	AAA(mex)	837,059,873	7.12%
94SP	SCOTIAB	19D	AAA(mex)	218,768,349	1.86%
Reportos				2,099,117	0.02%
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	2,099,117	0.02%
Certificados Bursatiles Corporativos (Spot)				172,355,521	1.47%
91SP	DAIMLER	19D	AAA(mex)	172,355,521	1.47%
TOTAL CARTERA				11,749,942,823	100.00%
ACTIVO NETO				11,716,955,417	

Cartera al: 29/11/2019

Límite Máximo de VaR: 1.373 %

Var Promedio: 0.873 %

Parámetros: 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."