

# Actinver | ACTICOB

Acticober, S.A. de C.V.

Fondo de Inversión 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	%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>78,346,261</b>	<b>1.00%</b>
CHD	40-110	9730399		61,743,928	0.79%
CHD	40-133	8009722		16,602,333	0.21%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>145,685,067</b>	<b>1.85%</b>
D2SP	AVALB32	220926	BB+	63,481,446	0.81%
D2SP	AAPLK68	230503	AA+	42,795,489	0.54%
D2SP	BBVAH99	300922	Baa2	21,654,177	0.28%
D2SP	GGBRA83	240429	BBB-	17,753,955	0.23%
	<b>Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)</b>			<b>1,567,873</b>	<b>0.02%</b>
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,567,873	0.02%
	<b>Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)</b>			<b>9,992,777</b>	<b>0.13%</b>
D7SP	ARBA605	240630	A+	9,992,777	0.13%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>292,594,854</b>	<b>3.72%</b>
D5SP	TNOTW91	260831	AA+	252,487,910	3.21%
D5SP	TNOTS89	310815	AA+	40,106,944	0.51%
	<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>6,669,257,937</b>	<b>84.82%</b>
1ISP	IB01	N		1,315,861,356	16.74%
1ISP	JU13	N		1,203,378,479	15.31%
1ISP	AFLT	N		831,690,936	10.58%
1ISP	VDST	N		637,893,596	8.11%
1ISP	FLOT	*		513,157,863	6.53%
1ISP	CORP	*		501,344,156	6.38%
1ISP	USFR	*		354,892,590	4.51%
1ISP	VGSH	*		342,582,472	4.36%
1ISP	VDTA	N		273,323,912	3.48%
1ISP	SHV	*		272,414,932	3.47%
1ISP	STPZ	*		211,831,651	2.69%
1ISP	TIPZ	*		210,885,995	2.68%
	<b>Títulos Emisoras Extranjeras SPOT</b>			<b>47,279,362</b>	<b>0.60%</b>

D8SP	BIMBO2	1-18	BBB	47,279,362	0.60%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios Spot</b>			<b>230,330,527</b>	<b>2.93%</b>
94SP	SCOTIAB	19D	AAA (mex)	230,330,527	2.93%
	<b>Reportos</b>			<b>1,040,318</b>	<b>0.01%</b>
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	1,040,318	0.01%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)</b>			<b>386,442,513</b>	<b>4.92%</b>
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	211,737,484	2.69%
91SP	DAIMLER	19D	AAA (mex)	174,705,029	2.22%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,862,537,489</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,856,746,462</b>	

Cartera al: 29/10/2021

Límite Máximo de VaR: 1.627 %

Var Promedio: 1.122 %

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