

MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				75,470,441	3.73%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,311,666	1.99%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,057,998	0.99%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,100,777	0.75%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,020,462,648	50.44%
91	SALUD	21	HR A+	99,843,640	4.94%
91	VWLEASE	24	mxAAA	90,404,738	4.47%
91	GICSA	19	B/M	87,189,422	4.31%
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	75,353,865	3.73%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,600,394	3.49%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,428,962	2.49%
91	LAB	23	AA (mex)	50,385,813	2.49%
91	TPLAYCB	24	HR AA	50,151,719	2.48%
91	GAP	24	mxAAA	50,125,892	2.48%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	50,109,380	2.48%
91	GHEMA	23	HR BBB+	50,069,652	2.48%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,067,416	2.48%
91	AERMXCB	19	AA+/M	47,093,221	2.33%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,268,426	1.99%
91	SALUD	20	HR A+	30,365,483	1.50%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	30,145,509	1.49%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,519,653	1.46%
91	AMX	23-3	AAA (mex)	25,080,210	1.24%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,136,410	1.00%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,045,053	0.74%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	8,077,791	0.40%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental				19,921,647	0.99%
92	CFE	00824	AAA(mex)	19,921,647	0.99%
Chequera Dolares				46,478,424	2.30%
CHD	40-110	1961770		39,749,145	1.97%

CHD	40-133	8035834		6,729,279	0.33%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				451,346,780	22.31%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	103,344,493	5.11%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	101,399,319	5.01%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	80,067,299	3.96%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	68,486,309	3.39%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	37,962,211	1.88%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	29,801,237	1.47%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	19,899,916	0.98%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	10,385,996	0.51%
Forward de Divisas				292,249	0.01%
FWD	MXPUSD	241126		-3,960,275	-0.20%
FWD	MXPUSD	241127		-1,530,150	-0.08%
FWD	MXPUSD	241126		3,773,718	0.19%
FWD	MXPUSD	241126		1,470,240	0.07%
FWD	MXPUSD	241127		538,716	0.03%
Titulos de Credito Extranjeros				25,686,117	1.27%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	25,686,117	1.27%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				175,033,063	8.65%
93	AMX	07824	F1+ (mex)	26,897,502	1.33%
93	AMX	11524	F1+ (mex)	19,392,260	0.96%
93	AMX	12124	F1+ (mex)	19,311,888	0.96%
93	PCARFM	04224	F1+ (mex)	15,156,815	0.75%
93	FINBE	01524	HR1	15,069,590	0.75%
93	AMX	13324	F1+ (mex)	14,335,064	0.71%
93	AMX	07524	F1+ (mex)	13,057,821	0.65%
93	AMX	13224	F1+ (mex)	12,749,299	0.63%
93	PCARFM	04424	F1+ (mex)	9,812,285	0.49%
93	SICREAC	00324	HR2	8,005,337	0.40%
93	MINSA	00124	HR2	6,570,144	0.33%
93	AUTLAN	00224	F2 (mex)	5,001,638	0.25%
93	AMX	12324	F1+ (mex)	4,916,240	0.24%
93	AMX	14324	F1+ (mex)	4,757,181	0.24%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu				120,934,502	5.98%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	120,934,502	5.98%
Reportos				87,407,766	4.32%
91	SIGMA	24-2	AAA (mex)	87,407,766	4.32%
TOTAL CARTERA				2,023,033,637	100.00%
ACTIVO NETO				2,031,368,362	

Cartera al:

07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.381 %

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>