

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				75,540,588	3.55%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,173,417	1.89%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,173,067	0.95%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,194,104	0.72%
Certificados Bursátiles Corporativos				749,359,762	35.25%
91	SALUD	21	HR A+	100,421,749	4.72%
91	GICSA	19	B/M	84,076,018	3.96%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,397,430	3.31%
91	AERMXCB	19	HR AA+	53,726,794	2.53%
91	GHEMA	23	HR BBB+	50,394,052	2.37%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,349,600	2.37%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,264,647	2.37%
91	LAB	23	AA (mex)	50,216,954	2.36%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,428,106	1.90%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,190,561	1.89%
91	SALUD	20	HR A+	30,265,532	1.42%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	30,045,300	1.41%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,412,417	1.38%
91	AMX	23-3	AAA (mex)	25,219,536	1.19%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,066,232	0.94%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,146,320	0.71%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	8,738,517	0.41%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental				39,500,265	1.86%
92	CFE	00124	F1+ (mex)	19,981,691	0.94%
92	CFE	00824	AAA(mex)	19,518,574	0.92%
Chequera Dolares				187,478,161	8.82%
CHD	40-133	8035834		147,961,866	6.96%
CHD	40-110	1961770		39,516,295	1.86%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				456,089,356	21.46%

D2SP	GRUMD74	241201	BBB	101,482,033	4.77%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	97,813,803	4.60%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	80,833,260	3.80%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	68,202,601	3.21%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	37,471,826	1.76%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	30,101,601	1.42%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	29,979,337	1.41%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	10,204,895	0.48%
Forward de Divisas				-284,822	-0.01%
FWD	MXUSD	241126		-4,052,990	-0.19%
FWD	MXUSD	241126		3,768,168	0.18%
Titulos de Credito Extranjeros				24,921,208	1.17%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	24,921,208	1.17%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				235,657,070	11.09%
93	TPLAY	00124	HR2	50,333,794	2.37%
93	FINBE	01124	HR1	40,224,481	1.89%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	29,408,312	1.38%
93	AMX	07824	F1+ (mex)	26,354,469	1.24%
93	AMX	11524	F1+ (mex)	18,995,693	0.89%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	18,668,454	0.88%
93	AMX	07524	F1+ (mex)	12,794,831	0.60%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,056,917	0.47%
93	PCARFM	03224	F1+ (mex)	9,969,705	0.47%
93	SICREAC	00224	HR2	8,049,896	0.38%
93	MINSA	00124	HR2	6,547,071	0.31%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	4,142,450	0.20%
93	AMX	09424	F1+ (mex)	110,999	0.01%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu				119,228,707	5.61%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	119,228,707	5.61%
Reportos				238,162,077	11.20%
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	105,761,753	4.98%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	70,049,943	3.30%
91	SIGMA	24-2	AAA (mex)	49,825,538	2.34%
91	TIPMxcb	23	AAA (mex)	12,524,842	0.59%
TOTAL CARTERA				2,125,652,372	100.00%
ACTIVO NETO				1,994,308,733	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.267 %

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>