

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				75,531,066	4.26%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,232,321	2.27%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,135,180	1.14%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,163,565	0.86%
Certificados Bursátiles Corporativos				767,073,055	43.29%
91	SALUD	21	HR A+	100,117,325	5.65%
91	GICSA	19	B/M	80,193,766	4.53%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,280,609	3.97%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,272,042	3.97%
91	AERMxcb	19	HR AA+	60,395,155	3.41%
91	GHEMA	23	HR A-	50,389,733	2.84%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,234,035	2.84%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,159,780	2.83%
91	LAB	23	AA (mex)	50,098,922	2.83%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,395,599	2.28%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,164,162	2.27%
91	SALUD	20	HR A+	30,206,228	1.71%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,633,412	1.67%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,020,188	1.13%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,105,163	0.85%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	9,406,939	0.53%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Chequera Dolares				53,992,762	3.05%
CHD	40-110	1961770		36,702,302	2.07%
CHD	40-133	8035834		17,290,460	0.98%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				392,367,164	22.14%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	93,239,336	5.26%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	92,009,872	5.19%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	73,892,553	4.17%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	62,271,850	3.51%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	34,180,352	1.93%

D2SP	LIVEE96	241002	BBB	27,529,415	1.55%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	9,243,786	0.52%
Forward de Divisas				5,447,550	0.31%
FWD	MXPUSD	240821		-2,200,215	-0.12%
FWD	MXPUSD	240821		7,647,765	0.43%
Opciones CALL Divisas				1,828,612	0.10%
CALL	MXPUSD	240814		1,828,612	0.10%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				296,946,333	16.76%
93	TPLAY	00124	HR2	50,209,046	2.83%
93	FINBE	00824	HR1	40,138,277	2.27%
93	PCARFM	02524	F1+ (mex)	39,700,124	2.24%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	28,824,420	1.63%
93	AMX	07824	F1+ (mex)	25,824,793	1.46%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,450,813	1.27%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	18,304,056	1.03%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	13,024,616	0.74%
93	AMX	07524	F1+ (mex)	12,538,391	0.71%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,199,751	0.63%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,035,448	0.57%
93	SICREAC	00224	HR2	8,032,470	0.45%
93	MINSA	00124	HR2	6,592,790	0.37%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,010,863	0.34%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	4,060,475	0.23%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu				109,787,904	6.20%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	109,787,904	6.20%
Reportos				69,060,854	3.90%
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	69,060,854	3.90%
TOTAL CARTERA				1,772,035,300	100.00%
ACTIVO NETO				1,779,827,556	
Cartera al:		28/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.274 %
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>