

## MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>				<b>75,456,965</b>	<b>4.25%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,192,392	2.27%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,115,874	1.13%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,148,699	0.85%
<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>				<b>766,618,064</b>	<b>43.20%</b>
91	SALUD	21	HR A+	100,004,136	5.64%
91	GICSA	19	B/M	79,936,417	4.51%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,210,209	3.96%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,205,407	3.96%
91	AERMxcb	19	HR AA+	60,331,727	3.40%
91	GHEMA	23	HR A-	50,331,180	2.84%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,185,432	2.83%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,109,932	2.82%
91	LAB	23	AA (mex)	50,049,712	2.82%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,356,484	2.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,119,729	2.26%
91	SALUD	20	HR A+	30,501,364	1.72%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,602,199	1.67%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,189,796	1.14%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,087,614	0.85%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	9,396,727	0.53%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>54,339,523</b>	<b>3.06%</b>
CHD	40-110	1961770		36,933,284	2.08%
CHD	40-133	8035834		17,406,239	0.98%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>394,743,153</b>	<b>22.25%</b>
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	93,650,891	5.28%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	92,663,609	5.22%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	74,353,880	4.19%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	62,660,840	3.53%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	34,410,757	1.94%

D2SP	LIVEE96	241002	BBB	27,698,931	1.56%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	9,304,245	0.52%
<b>Forward de Divisas</b>				<b>5,440,230</b>	<b>0.31%</b>
FWD	MXPUSD	240821		-2,887,360	-0.16%
FWD	MXPUSD	240821		8,327,590	0.47%
<b>Opciones CALL Divisas</b>				<b>2,214,280</b>	<b>0.13%</b>
CALL	MXPUSD	240814		2,214,280	0.13%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>296,657,990</b>	<b>16.72%</b>
93	TPLAY	00124	HR2	50,153,928	2.83%
93	FINBE	00824	HR1	40,101,320	2.26%
93	PCARFM	02524	F1+ (mex)	39,663,034	2.24%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	28,797,139	1.62%
93	AMX	07824	F1+ (mex)	25,799,511	1.45%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,429,662	1.26%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	18,287,261	1.03%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	13,012,609	0.73%
93	AMX	07524	F1+ (mex)	12,526,207	0.71%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,189,140	0.63%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,025,784	0.57%
93	SICREAC	00224	HR2	8,024,351	0.45%
93	MINSA	00124	HR2	6,586,375	0.37%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,005,005	0.34%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	4,056,665	0.23%
<b>Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu</b>				<b>110,479,191</b>	<b>6.23%</b>
51	ACTICOB	FF	HR AAA	110,479,191	6.23%
<b>Reportos</b>				<b>68,466,606</b>	<b>3.86%</b>
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	68,466,606	3.86%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,774,416,002</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>1,782,496,394</b>	

**Cartera al: 27/06/2024**

**Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.273 %**  
**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>