

## 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>75,540,802</b>	<b>4.41%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,237,415	2.35%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,137,677	1.18%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,165,710	0.89%
<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>				<b>769,778,581</b>	<b>44.91%</b>
91	SALUD	21	HR A+	100,097,881	5.84%
91	GICSA	19	B/M	79,057,586	4.61%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,284,038	4.10%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,272,274	4.10%
91	AERMXCB	19	HR AA+	63,845,509	3.72%
91	GHEMA	23	HR A-	50,389,323	2.94%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,233,943	2.93%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,163,025	2.93%
91	LAB	23	AA (mex)	50,098,476	2.92%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,398,819	2.36%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,208,354	2.35%
91	SALUD	20	HR A+	30,215,597	1.76%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,633,785	1.73%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,020,315	1.17%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,105,039	0.88%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	9,754,619	0.57%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>47,489,276</b>	<b>2.77%</b>
CHD	40-110	1961770		34,219,203	2.00%
CHD	40-133	8035834		13,270,073	0.77%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>363,763,683</b>	<b>21.22%</b>
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	88,168,697	5.14%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	84,553,024	4.93%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	67,894,906	3.96%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	57,467,471	3.35%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	31,381,187	1.83%

D2SP	LIVEE96	241002	BBB	25,413,669	1.48%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	8,884,729	0.52%
	<b>Forward de Divisas</b>			<b>1,514,790</b>	<b>0.09%</b>
FWD	MXPUSD	240821		1,514,790	0.09%
	<b>Opciones CALL Divisas</b>			<b>350,620</b>	<b>0.02%</b>
CALL	MXPUSD	240814		350,620	0.02%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>265,460,925</b>	<b>15.49%</b>
93	TPLAY	00124	HR2	50,207,498	2.93%
93	FINBE	00724	HR1	40,138,190	2.34%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	28,571,975	1.67%
93	PCARFM	02124	F1+ (mex)	28,476,165	1.66%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,450,551	1.31%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	18,143,880	1.06%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,911,889	0.75%
93	AMX	07524	F1+ (mex)	12,428,722	0.73%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,100,394	0.65%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,035,439	0.59%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,635,875	0.50%
93	MINSA	00124	HR2	6,590,997	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,010,857	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,733,581	0.33%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	4,024,913	0.24%
	<b>Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu</b>			<b>101,560,880</b>	<b>5.93%</b>
51	ACTICOB	FF	HR AAA	101,560,880	5.93%
	<b>Reportos</b>			<b>88,747,452</b>	<b>5.18%</b>
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	88,747,452	5.18%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,714,207,009</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,721,876,480</b>	

**Cartera al: 31/05/2024**

**Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.290 %**  
**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>