

Actinver | ACTIREN

ACTIREN, S.A. de C.V.

Sociedad de Inversión en Instrumentos de Deuda

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA AL 30 NOVIEMBRE DE 2016
CIFRAS EN PESOS

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Corporativos				2,388,744,390	18.63%
91	DINEXCB	16	AA-(mex)	157,689,109	1.23%
91	SORIANA	15	AA+(mex)	301,320,231	2.35%
91	FUNO	13	AAA(mex)	287,282,061	2.24%
91	IENOVA	13-2	Aa1.mx	250,648,635	1.96%
91	GCARSO	12	AAA(mex)	211,393,078	1.65%
91	VWLEASE	13-2	mxAAA	135,574,466	1.06%
91	BLADEX	14	AAA(mex)	134,951,106	1.05%
91	KIMBER	13-2	AAA(mex)	125,166,700	0.98%
91	INCARSO	13	AA(mex)	111,666,568	0.87%
91	ARCA	09-5	AAA(mex)	88,656,443	0.69%
91	VWLEASE	13	mxAAA	79,265,737	0.62%
91	DAIMLER	14-2	AAA(mex)	68,921,235	0.54%
91	TELMEX	08	mxAAA	52,269,226	0.41%
91	FORD	14-2	Aa2.mx	50,099,977	0.39%
91	AMX	08	mxAAA	49,864,245	0.39%
91	VWLEASE	14-2	mxAAA	45,759,258	0.36%
91	GICSA	15-2	mxA	44,151,103	0.34%
91	MFRISCO	13	A-(mex)	41,909,836	0.33%
91	DAIMLER	15	AAA(mex)	32,023,528	0.25%
91	CATFIN	12	mxAAA	28,098,415	0.22%
91	GFAMSA	16	BBB-(mex)	25,080,047	0.20%
91	INCARSO	12	AA(mex)	22,957,291	0.18%
91	LIVEPOL	12	AAA(mex)	20,096,617	0.16%
91	CATFIN	14	mxAAA	17,062,083	0.13%
91	TOYOTA	14	AAA(mex)	6,837,395	0.05%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				144,062,471	1.12%
93	GMFIN	04116	F1+(mex)	50,209,222	0.39%
93	ABREGIO	00316	F1+(mex)	47,353,249	0.37%
93	DAIMLER	06616	F1+(mex)	46,500,000	0.36%
Certificado Bursátiles Bancario				720,840,583	5.62%
94	BSANT	15	AAA(mex)	177,096,152	1.38%
94	BINBUR	13-4	mxAAA	166,785,499	1.30%
94	BINBUR	14	mxAAA	105,860,244	0.83%
94	BANAMEX	10	AAA(mex)	95,306,799	0.74%
94	BACOMER	15	AAA(mex)	60,130,524	0.47%
94	BINBUR	14-3	mxAAA	60,182,527	0.47%
94	BINTER	14-3	A+(mex)	55,478,838	0.43%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				290,762,754	2.27%

95	PEMEX	12	Aa3.mx	90,301,420	0.70%
95	CFEGCB	13	Aa1.mx	70,019,734	0.55%
95	CFECB	10-2	Aa1.mx	40,215,154	0.31%
95	FEFA	14	AAA(mex)	30,120,872	0.24%
95	CFEHCB	07-2	Aa1.mx	21,730,545	0.17%
95	PEMEX	11-2	Aa3.mx	19,988,741	0.16%
95	CFECB	10	Aa1.mx	8,627,298	0.07%
95	CFECB	07	Aa1.mx	7,020,470	0.06%
95	CFEHCB	07	Aa1.mx	2,738,520	0.02%
Chequera Dolares				1,128,043	0.01%
CHD	40-012	2993511		1,128,043	0.01%
Títulos Emisoras Extranjeras SIC				14,912,282	0.12%
D8	MLMXN	1-07	AA-	14,912,282	0.12%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				147,966,450	1.15%
I	BACTINV	17084	HR1	147,966,450	1.15%
Bonos de Protección al Ahorro (BPAG91)				135,854,527	1.06%
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	135,854,527	1.06%
Títulos de Credito Extranjeros				119,784,315	0.93%
JE	AMX	0619	AAA(mex)	119,784,315	0.93%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				80,589,539	0.63%
JI	CABEI	1-16	mxAAA	48,001,632	0.37%
JI	CABEI	2-15	mxAAA	32,587,907	0.25%
Bondes D				282,723,480	2.21%
LD	BONDESD	161229	AAA(mex)	252,612,271	1.97%
LD	BONDESD	170223	AAA(mex)	30,111,209	0.24%
REPORTOS				8,495,662,177	66.25%
M	BONOS	161215	AAA(mex)	2,266,102,201	17.67%
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	2,252,292,560	17.56%
IQ	BPAG91	210826	AAA(mex)	1,315,394,831	10.26%
LD	BONDESD	170223	AAA(mex)	840,865,288	6.56%
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	650,095,611	5.07%
IM	BPAG28	190725	AAA(mex)	601,313,541	4.69%
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	260,408,110	2.03%
LD	BONDESD	180628	AAA(mex)	155,276,717	1.21%
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	91,511,882	0.71%
LD	BONDESD	200924	AAA(mex)	62,401,436	0.49%
TOTAL CARTERA				12,823,031,011	100.00%
ACTIVO NETO				12,802,089,169	
Límite Máximo de VaR:		0.100%	Var Promedio:	0.006%	
PARÁMETROS:		Modelo Histórico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 252			
<small>Límite autorizado por CNBV %</small>					

CALIFICACIÓN:
Escala Homogénea: AAA/4HR

CLASIFICACIÓN:
SOCIEDAD DE CORTO PLAZO

Calificación otorgada por la empresa HR RATINGS DE MEXICO SA DE CV