

Actinver | ACTICOB

Acticober, S.A. de C.V.

Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|---|---------|--------------|----------------------|---------------|
| | Chequera Dolares | | | 33,896,765 | 0.44% |
| CHD | 40-133 | 8009722 | | 33,896,765 | 0.44% |
| | Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot) | | | 132,061,067 | 1.72% |
| D2SP | AVALB32 | 220926 | BB+ | 65,802,852 | 0.86% |
| D2SP | AAPLK68 | 230503 | AA+ | 43,821,692 | 0.57% |
| D2SP | BBVAH99 | 300922 | Baa2 | 22,436,523 | 0.29% |
| | Oper. Instrum. Fin. Derivados (Excedente Aport. Inic. Mín) | | | 1,567,873 | 0.02% |
| EAIM | RJOBRIE | 9510018 | | 1,567,873 | 0.02% |
| | Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit. Extranjero (Spot) | | | 10,363,385 | 0.14% |
| D7SP | ARBA605 | 240630 | A+ | 10,363,385 | 0.14% |
| | Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot) | | | 6,799,176,098 | 88.61% |
| 1ISP | IB01 | N | | 1,321,842,457 | 17.23% |
| 1ISP | JU13 | N | | 1,012,072,098 | 13.19% |
| 1ISP | AFLT | N | | 861,985,066 | 11.23% |
| 1ISP | VDST | N | | 661,501,940 | 8.62% |
| 1ISP | FLOT | * | | 531,141,835 | 6.92% |
| 1ISP | CORP | * | | 518,009,812 | 6.75% |
| 1ISP | USFR | * | | 368,054,706 | 4.80% |
| 1ISP | VGSH | * | | 354,475,418 | 4.62% |
| 1ISP | VDTA | N | | 285,619,818 | 3.72% |
| 1ISP | VWOB | * | | 237,012,144 | 3.09% |
| 1ISP | TIPZ | * | | 220,161,994 | 2.87% |
| 1ISP | STPZ | * | | 219,289,054 | 2.86% |
| 1ISP | SHV | * | | 208,009,755 | 2.71% |
| | Títulos Emisoras Extranjeras SPOT | | | 48,876,965 | 0.64% |
| D8SP | BIMBO2 | 1-18 | BBB | 48,876,965 | 0.64% |
| | Certificados Bursátiles Bancarios Spot | | | 238,589,303 | 3.11% |
| 94SP | SCOTIAB | 19D | AAA (mex) | 238,589,303 | 3.11% |
| | Reportos | | | 7,979,583 | 0.10% |
| LD | BONDESD | 250220 | AAA(mex) | 7,979,583 | 0.10% |
| | Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot) | | | 400,651,299 | 5.22% |
| JISP | CABEG74 | 260209 | AAA (mex) | 219,463,337 | 2.86% |

| | | | | | |
|---|---------|-------------------|------------------------------|----------------------|----------------|
| 91SP | DAIMLER | 19D | AAA (mex) | 181,187,962 | 2.36% |
| TOTAL CARTERA | | | | 7,673,162,338 | 100.00% |
| ACTIVO NETO | | | | 7,621,731,963 | |
| Cartera al: | | 2/Dic/2021 | | | |
| Límite Máximo de VaR: 1.600 % | | | Var Promedio: 1.076 % | | |
| Parámetros: 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." | | | | | |