

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			96,778,865	1.37%
CD	NAFF	250307	AAA (mex)	96,778,865	1.37%
	Certificados Bursátiles Bancarios			315,628,144	4.46%
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,210,352	2.84%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	63,734,786	0.90%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,683,006	0.72%
	Certificados Bursátiles Corporativos			3,127,029,735	44.18%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	249,881,218	3.53%
91	TPLAYCB	20	HR AA	224,210,809	3.17%
91	AERMxcb	19	HR AA+	174,687,856	2.47%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	164,247,151	2.32%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	131,688,006	1.86%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	131,233,682	1.85%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,052,478	1.75%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,247,037	1.70%
91	NM	24	mxAA+	100,358,202	1.42%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,324,551	1.42%
91	DONDE	23	HR AA	100,126,729	1.42%
91	SALUD	21	HR A+	99,967,129	1.41%
91	GAP	21	mxAAA	92,208,534	1.30%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	90,665,953	1.28%
91	ARA	23X	mxAA-	90,516,477	1.28%
91	LALA	19-2	AA (mex)	87,295,006	1.23%
91	GICSA	19	B/M	85,572,157	1.21%
91	SALUD	20	HR A+	81,385,632	1.15%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,371,869	1.07%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,314,501	1.06%
91	TPLAY	22	HR A	74,979,347	1.06%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,108,104	0.91%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,121,695	0.85%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	60,003,549	0.85%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,640,577	0.83%

91	ALSEA	19	A+ (mex)	50,372,911	0.71%
91	GHEMA	23	HR A-	50,331,180	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	42,514,335	0.60%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,538,989	0.57%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,045,886	0.57%
91	LAB	23	AA (mex)	35,034,705	0.50%
91	GICSA	17	B/M	33,242,728	0.47%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,174,999	0.43%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,091,912	0.36%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,999,378	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,168,507	0.29%
91	GAP	20	mxAAA	11,232,808	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	10,073,152	0.14%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,619,616,251	22.89%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	721,975,875	10.20%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	525,071,188	7.42%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	347,772,841	4.91%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	24,796,348	0.35%
	Chequera Dolares			12,194,219	0.17%
CHD	40-133	8034399		12,194,219	0.17%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,536,330	1.42%
D2	GS227	240515	BBB+	100,536,330	1.42%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			321,842,153	4.55%
93	ELEKTRA	00124	HR1	120,995,447	1.71%
93	TPLAY	00124	HR2	100,331,772	1.42%
93	DONDE	00124	HR1	50,251,328	0.71%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,039,387	0.21%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,971,510	0.20%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	12,361,428	0.18%
93	HYCSA	00123	HR2	8,891,282	0.13%
	Swaps Entregables			-25,891,250	-0.37%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,140,000	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240802		-718,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-4,191,500	-0.06%
SWP	2TIEMXP	250815		-3,672,500	-0.05%
SWP	2TIEMXP	241111		-169,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-7,406,250	-0.11%
SWP	2TIEMXP	260317		-9,046,000	-0.13%
SWP	2TIEMXP	240926		452,000	0.01%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			423,449,821	5.98%

95	PEMEX	19	mxAAA	207,419,258	2.93%
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	125,688,811	1.78%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,341,752	1.28%
	Reportos			1,086,125,377	15.35%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	1,086,125,377	15.35%
	TOTAL CARTERA			7,077,309,645	100.00%
	ACTIVO NETO			7,052,684,510	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.300 % Var Promedio: 0.075 %
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."