

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				185,817,668	5.52%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,048,566	1.84%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,369,962	1.76%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,881,581	1.04%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,517,559	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,876,475,085	55.70%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,353,094	4.46%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,052,478	3.68%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,247,037	3.57%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	104,861,993	3.11%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,948,986	3.00%
91	ARA	23X	mxAA-	100,573,863	2.99%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,510,763	2.98%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,408,328	2.98%
91	DONDE	23	HR AA	100,126,729	2.97%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	91,168,619	2.71%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,202,087	2.68%
91	TPLAYCB	20	HR AA	83,660,750	2.48%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,135,130	2.38%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,371,869	2.24%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,314,501	2.24%
91	TPLAY	22	HR A	74,979,347	2.23%
91	SALUD	20	HR A+	74,773,049	2.22%
91	SALUD	21	HR A+	50,388,131	1.50%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,233,332	1.19%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,201,471	1.19%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,045,886	1.19%
91	HYCSA	24	HR AA	20,168,507	0.60%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,095,099	0.60%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,654,037	0.52%
Certificados De La Tesorería De La Federación				292,208,826	8.67%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	273,037,018	8.10%

BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,259,652	0.54%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	912,156	0.03%
	Chequera Dolares			157,327	0.01%
CHD	40-133	8355257		157,327	0.01%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,536,330	2.98%
D2	GS227	240515	BBB+	100,536,330	2.98%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,720,821	3.26%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,829,539	2.99%
93	HYCSA	00123	HR2	8,891,282	0.26%
	Swaps Entregables			-3,687,950	-0.11%
SWP	2TIEMXP	250207		-760,000	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240705		-451,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-359,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-118,300	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-2,468,750	-0.07%
SWP	2TIEMXP	240926		452,000	0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		17,100	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,535,050	3.70%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,535,050	3.70%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			90,341,752	2.68%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,341,752	2.68%
	Reportos			593,001,307	17.60%
LD	BONDES	250814	AAA(mex)	593,001,307	17.60%
	TOTAL CARTERA			3,369,106,216	100.00%
	ACTIVO NETO			3,378,470,818	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.031 %
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."