

## 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>75,461,516</b>	<b>4.42%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,126,276	2.35%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,142,377	1.18%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,192,863	0.89%
<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>				<b>813,165,829</b>	<b>47.62%</b>
91	SALUD	21	HR A+	100,231,052	5.87%
91	GICSA	19	B/M	77,128,597	4.52%
91	AERMXCB	19	HR AA+	70,737,885	4.14%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,366,020	4.12%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,353,927	4.12%
91	GHEMA	23	HR A-	50,476,899	2.96%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,308,884	2.95%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,237,376	2.94%
91	LAB	23	AA (mex)	50,164,538	2.94%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,350,460	2.36%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	40,015,014	2.34%
91	SALUD	20	HR A+	30,279,172	1.77%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,385,590	1.72%
91	VASCONI	19	HR D	21,985,542	1.29%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,047,294	1.17%
91	VASCONI	22L	HR D	15,500,000	0.91%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,131,289	0.89%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	10,466,290	0.61%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>14,809,196</b>	<b>0.87%</b>
CHD	40-133	8035834		14,809,196	0.87%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>342,079,482</b>	<b>20.03%</b>
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	84,682,652	4.96%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	80,362,305	4.71%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	66,997,811	3.92%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	55,177,742	3.23%

D2SP	ORBIB11	260511	BBB	30,447,512	1.78%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	24,411,459	1.43%
<b>Forward de Divisas</b>				<b>-3,235,523</b>	<b>-0.19%</b>
FWD	MXPUSD	240412		-10,536,255	-0.62%
FWD	MXPUSD	240430		-3,263,544	-0.19%
FWD	MXPUSD	240430		-4,324,160	-0.25%
FWD	MXPUSD	240430		14,888,436	0.87%
<b>Opciones CALL Divisas</b>				<b>336,096</b>	<b>0.02%</b>
CALL	MXPUSD	240814		336,096	0.02%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>200,948,761</b>	<b>11.77%</b>
93	TPLAY	00123	HR2	60,343,261	3.53%
93	FINBE	00524	F1+ (mex)	30,009,443	1.76%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,281,767	1.31%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	17,855,385	1.05%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	14,778,900	0.87%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,701,455	0.74%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,035,482	0.59%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,627,774	0.51%
93	MINSA	00124	HR2	6,539,633	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,018,696	0.35%
93	LAB	00823	F1+ (mex)	6,015,019	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,741,946	0.34%
<b>Reportos</b>				<b>263,942,034</b>	<b>15.46%</b>
91	GAP	23-2L	mxAAA	96,838,050	5.67%
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	89,321,954	5.23%
91	EDUCA	23L	HR AAA	64,342,098	3.77%
91	HIR	22	HR AA-	13,439,932	0.79%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,707,507,391</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>1,717,795,913</b>	

**Cartera al: 11/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.304 %**  
**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."**