

## 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>75,305,467</b>	<b>4.34%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,031,333	2.30%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,121,035	1.16%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,153,099	0.87%
<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>				<b>849,478,583</b>	<b>48.90%</b>
91	SALUD	21	HR A+	99,967,129	5.75%
91	GICSA	19	B/M	77,792,870	4.48%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,177,273	4.04%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,164,777	4.04%
91	AERMXCB	19	HR AA+	67,187,637	3.87%
91	GHEMA	23	HR A-	50,331,180	2.90%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,186,096	2.89%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,117,278	2.89%
91	LAB	23	AA (mex)	50,049,578	2.88%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	40,298,328	2.32%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,257,822	2.32%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,163,331	2.31%
91	SALUD	20	HR A+	30,519,612	1.76%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,603,399	1.70%
91	VASCONI	19	HR D	21,803,833	1.26%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,189,797	1.16%
91	VASCONI	22L	HR D	15,500,000	0.89%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,087,500	0.87%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	10,081,145	0.58%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>148,889,319</b>	<b>8.57%</b>
CHD	40-110	1961770		136,192,726	7.84%
CHD	40-133	8035834		12,696,593	0.73%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>361,981,694</b>	<b>20.84%</b>
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	87,823,660	5.06%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	83,742,874	4.82%

D2SP	PEMEH20	251016	BBB	67,340,301	3.88%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	57,385,345	3.30%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	31,500,392	1.81%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	25,331,885	1.46%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	8,857,237	0.51%
<b>Opciones CALL Divisas</b>				<b>624,252</b>	<b>0.04%</b>
CALL	MXPUSD	240814		624,252	0.04%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>194,354,779</b>	<b>11.19%</b>
93	TPLAY	00124	HR2	50,165,886	2.89%
93	FINBE	00524	F1+ (mex)	30,208,500	1.74%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,429,493	1.29%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	17,970,981	1.03%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	14,876,192	0.86%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,789,413	0.74%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,025,861	0.58%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,627,777	0.50%
93	MINSA	00124	HR2	6,584,608	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,005,009	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,727,665	0.33%
93	PCARFM	01724	F1+ (mex)	4,957,366	0.29%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	3,986,029	0.23%
<b>Reportos</b>				<b>106,697,187</b>	<b>6.14%</b>
91	EDUCA	23L	HR AAA	64,276,357	3.70%
91	GAP	23-2L	mxAAA	29,870,612	1.72%
91	HIR	22	HR AA-	12,550,217	0.72%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,737,331,281</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>1,742,988,256</b>	

**Cartera al:** 02/05/2024

**Límite Máximo de VaR:** 1.500 % **Var Promedio:** 0.315 %

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."