

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				186,096,722	5.53%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,343,068	1.85%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,098,206	1.76%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	35,040,134	1.04%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,615,315	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,883,965,733	55.98%
91	LALA	19-2	AA (mex)	151,095,780	4.49%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,415,210	3.67%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,600,033	3.55%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	104,370,086	3.10%
91	VOLARCB	23	HR AA+	101,137,884	3.01%
91	DONDE	23	HR AA	100,637,004	2.99%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,473,558	2.99%
91	ARA	23X	mxAA-	100,071,076	2.97%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,064,962	2.97%
91	TPLAYCB	20	HR AA	90,885,831	2.70%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	90,704,504	2.70%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,625,010	2.69%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,514,463	2.39%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,741,878	2.25%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,729,222	2.25%
91	TPLAY	22	HR A	75,376,124	2.24%
91	SALUD	20	HR A+	74,379,921	2.21%
91	SALUD	21	HR A+	50,654,905	1.51%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,391,214	1.20%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,259,217	1.20%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,015,248	1.19%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,194,103	0.60%
91	HYCSA	24	HR AA	20,061,138	0.60%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,567,362	0.52%
Certificados De La Tesorería De La Federación				291,032,108	8.65%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	271,941,638	8.08%

BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,182,184	0.54%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	908,286	0.03%
	Chequera Dolares			158,765	0.01%
CHD	40-133	8355257		158,765	0.01%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,075,162	2.97%
D2	GS227	240515	BBB+	100,075,162	2.97%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,191,112	3.24%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,344,937	2.98%
93	HYCSA	00123	HR2	8,846,175	0.26%
	Swaps Entregables			-3,600,500	-0.11%
SWP	2TIEMXP	250207		-608,500	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240705		-419,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-330,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-151,200	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-2,557,500	-0.08%
SWP	2TIEMXP	240926		444,400	0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		21,300	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			123,981,729	3.68%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	123,981,729	3.68%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			90,756,987	2.70%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,756,987	2.70%
	Reportos			583,983,133	17.35%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	399,639,777	11.87%
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	184,343,356	5.48%
	TOTAL CARTERA			3,365,640,951	100.00%
	ACTIVO NETO			3,394,938,280	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.034 %
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."