

MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				75,492,736	4.36%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,221,334	2.32%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,187,672	1.17%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,083,730	0.87%
Certificados Bursátiles Corporativos				850,207,954	49.06%
91	SALUD	21	HR A+	100,496,392	5.80%
91	GICSA	19	B/M	76,999,535	4.44%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,531,721	4.07%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,511,364	4.07%
91	AERMXCB	19	HR AA+	66,858,070	3.86%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,422,964	2.91%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,354,540	2.91%
91	LAB	23	AA (mex)	50,280,175	2.90%
91	GHEMA	23	HR A-	50,058,379	2.89%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,455,154	2.33%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	40,109,289	2.31%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,052,545	2.31%
91	SALUD	20	HR A+	30,359,151	1.75%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,458,057	1.70%
91	VASCONI	19	HR D	22,167,250	1.28%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,094,712	1.16%
91	VASCONI	22L	HR D	15,500,000	0.89%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,005,718	0.87%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	10,492,940	0.61%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Chequera Dolares				106,967,335	6.17%
CHD	40-110	1961770		85,329,603	4.92%
CHD	40-133	8035834		21,637,732	1.25%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				352,547,631	20.34%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	87,970,110	5.08%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	82,986,720	4.79%

D2SP	PEMEH20	251016	BBB	67,115,873	3.87%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	57,550,867	3.32%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	31,563,210	1.82%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	25,360,852	1.46%
Forward de Divisas				9,121,132	0.53%
FWD	MXPUSD	240430		-864,076	-0.05%
FWD	MXPUSD	240430		-1,325,350	-0.08%
FWD	MXPUSD	240430		11,310,558	0.65%
Opciones CALL Divisas				838,160	0.05%
CALL	MXPUSD	240814		838,160	0.05%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				201,349,580	11.62%
93	TPLAY	00123	HR2	60,490,012	3.49%
93	FINBE	00524	F1+ (mex)	30,075,715	1.74%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,330,934	1.29%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	17,890,522	1.03%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	14,812,093	0.86%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,729,099	0.73%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,058,145	0.58%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,646,797	0.50%
93	MINSA	00124	HR2	6,554,600	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,032,466	0.35%
93	LAB	00823	F1+ (mex)	6,028,281	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,700,915	0.33%
Reportos				136,518,204	7.88%
91	GAP	23-2L	mxAAA	88,625,140	5.11%
91	EDUCA	23L	HR AAA	34,417,735	1.99%
91	HIR	22	HR AA-	13,475,328	0.78%
TOTAL CARTERA				1,733,042,732	100.00%
ACTIVO NETO				1,737,850,268	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.307 %
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."