

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				186,465,616	5.48%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,566,252	1.84%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,302,568	1.74%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,837,549	1.03%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,759,247	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,893,199,118	55.68%
91	LALA	19-2	AA (mex)	151,625,765	4.46%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,030,569	3.65%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,082,955	3.53%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	104,742,926	3.08%
91	DONDE	23	HR AA	100,866,667	2.97%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,831,541	2.97%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,466,371	2.96%
91	ARA	23X	mxAA-	100,448,270	2.95%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,398,722	2.95%
91	TPLAYCB	20	HR AA	97,872,578	2.88%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	91,130,975	2.68%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,946,076	2.68%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,803,138	2.38%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,283,854	2.21%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,213,159	2.21%
91	TPLAY	22	HR A	74,847,652	2.20%
91	SALUD	20	HR A+	74,696,145	2.20%
91	SALUD	21	HR A+	50,311,722	1.48%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,419,882	1.19%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,178,217	1.18%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,156,705	1.18%
91	HYCSA	24	HR AA	20,141,154	0.59%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,071,389	0.59%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,632,686	0.52%
Certificados De La Tesorería De La Federación				292,072,136	8.59%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	273,080,178	8.03%

BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,088,359	0.53%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	903,599	0.03%
	Chequera Dolares			16,715,876	0.49%
CHD	40-133	8355257		16,715,876	0.49%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,431,724	2.95%
D2	GS227	240515	BBB+	100,431,724	2.95%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,587,951	3.22%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,708,587	2.96%
93	HYCSA	00123	HR2	8,879,364	0.26%
	Swaps Entregables			-408,650	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240705		-634,000	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240802		-387,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	260218		-292,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240926		683,600	0.02%
SWP	2TIEMXP	240905		104,400	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		71,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		45,850	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,398,413	3.66%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,398,413	3.66%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			91,031,535	2.68%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	91,031,535	2.68%
	Reportos			586,918,322	17.26%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	586,918,322	17.26%
	TOTAL CARTERA			3,400,412,041	100.00%
	ACTIVO NETO			3,383,718,490	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.042 %
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."