

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				75,650,282	4.36%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,296,190	2.32%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,166,228	1.16%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,187,865	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				811,038,617	46.76%
91	SALUD	21	HR A+	100,231,598	5.78%
91	GICSA	19	B/M	78,519,591	4.53%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,342,787	4.06%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,321,557	4.05%
91	AERMXCB	19	HR AA+	67,352,865	3.88%
91	GHEMA	23	HR A-	50,468,025	2.91%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,299,782	2.90%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,234,004	2.90%
91	LAB	23	AA (mex)	50,164,795	2.89%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,412,948	2.33%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,267,448	2.32%
91	SALUD	20	HR A+	30,270,127	1.75%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,384,978	1.69%
91	VASCONI	19	HR D	21,985,542	1.27%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,047,257	1.16%
91	VASCONI	22L	HR D	15,500,000	0.89%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,128,521	0.87%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	10,106,791	0.58%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Chequera Dolares				147,230,101	8.49%
CHD	40-110	1961770		134,414,210	7.75%
CHD	40-133	8035834		12,815,890	0.74%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				359,624,534	20.73%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	86,978,386	5.02%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	83,789,197	4.83%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	67,042,328	3.87%

D2SP	LIVEF61	261006	BBB	56,710,372	3.27%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	31,235,342	1.80%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	25,092,832	1.45%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	8,776,076	0.51%
Opciones CALL Divisas				416,720	0.02%
CALL	MXPUSD	240814		416,720	0.02%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				233,919,340	13.49%
93	TPLAY	00124	HR2	50,294,540	2.90%
93	FINBE	00524	F1+ (mex)	30,276,347	1.75%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	28,357,521	1.64%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,281,848	1.29%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	18,009,362	1.04%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	14,908,163	0.86%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,816,072	0.74%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,017,646	0.64%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,048,476	0.58%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,646,772	0.50%
93	MINSA	00124	HR2	6,539,632	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,018,728	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,741,073	0.33%
93	PCARFM	01724	F1+ (mex)	4,968,351	0.29%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	3,994,810	0.23%
Reportos				106,559,182	6.14%
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	106,559,182	6.14%
TOTAL CARTERA				1,734,438,776	100.00%
ACTIVO NETO				1,741,878,176	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.312 %
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."