

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				186,346,372	5.54%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,617,388	1.86%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,350,529	1.76%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,870,355	1.04%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,508,100	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,877,982,904	55.78%
91	LALA	19-2	AA (mex)	151,723,745	4.51%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,006,888	3.68%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,200,734	3.57%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	104,826,807	3.11%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,914,970	3.00%
91	ARA	23X	mxAA-	100,537,899	2.99%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,478,887	2.98%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,371,199	2.98%
91	DONDE	23	HR AA	100,090,396	2.97%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	91,135,430	2.71%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,172,114	2.68%
91	TPLAYCB	20	HR AA	83,629,643	2.48%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,863,842	2.40%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,346,492	2.24%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,285,914	2.24%
91	TPLAY	22	HR A	74,950,063	2.23%
91	SALUD	20	HR A+	74,744,914	2.22%
91	SALUD	21	HR A+	50,369,116	1.50%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,217,729	1.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,188,478	1.19%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,030,686	1.19%
91	HYCSA	24	HR AA	20,160,824	0.60%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,088,300	0.60%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,647,836	0.52%
Certificados De La Tesorería De La Federación				291,747,585	8.67%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	272,581,985	8.10%

BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,253,739	0.54%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	911,861	0.03%
	Chequera Dolares			159,566	0.01%
CHD	40-133	8355257		159,566	0.01%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,503,352	2.99%
D2	GS227	240515	BBB+	100,503,352	2.99%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,682,930	3.26%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,794,870	2.99%
93	HYCSA	00123	HR2	8,888,060	0.26%
	Swaps Entregables			-4,773,000	-0.14%
SWP	2TIEMXP	250207		-885,000	-0.03%
SWP	2TIEMXP	240705		-447,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-368,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		-4,200	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-158,550	-0.01%
SWP	2TIEMXP	260218		-3,325,750	-0.10%
SWP	2TIEMXP	240926		416,000	0.01%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,495,474	3.70%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,495,474	3.70%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			90,312,553	2.68%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,312,553	2.68%
	Reportos			590,284,814	17.53%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	590,284,814	17.53%
	TOTAL CARTERA			3,366,742,550	100.00%
	ACTIVO NETO			3,376,036,933	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.033 %
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."