

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				186,258,155	5.53%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,367,993	1.85%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,427,758	1.76%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,920,432	1.04%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,541,972	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,864,846,142	55.32%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,608,652	4.47%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,052,603	3.68%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,385,104	3.57%
91	ARA	23X	mxAA-	100,831,074	2.99%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,607,606	2.99%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,520,884	2.98%
91	DONDE	23	HR AA	100,234,231	2.97%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,190,096	2.97%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,101,574	2.97%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	91,121,681	2.70%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,342,851	2.68%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,209,630	2.38%
91	TPLAYCB	20	HR AA	76,640,700	2.27%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,446,890	2.24%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,399,557	2.24%
91	TPLAY	22	HR A	75,080,923	2.23%
91	SALUD	20	HR A+	74,028,214	2.20%
91	SALUD	21	HR A+	50,454,037	1.50%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,280,103	1.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,239,800	1.19%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,091,055	1.19%
91	HYCSA	24	HR AA	20,191,407	0.60%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,115,314	0.60%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,672,158	0.52%
Certificados De La Tesorería De La Federación				622,570,637	18.47%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	275,602,405	8.18%

BI	CETES	250529	AAA(mex)	224,720,800	6.67%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	102,895,050	3.05%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,431,634	0.55%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	920,748	0.03%
	Chequera Dolares			158,150	0.01%
CHD	40-133	8355257		158,150	0.01%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,833,707	3.26%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,932,821	2.99%
93	HYCSA	00123	HR2	8,900,886	0.26%
	Swaps Entregables			-2,919,150	-0.09%
SWP	2TIEMXP	250207		-389,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240705		-297,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-250,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-42,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-2,406,250	-0.07%
SWP	2TIEMXP	240926		422,000	0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		44,100	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,835,684	3.70%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,835,684	3.70%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			190,749,716	5.66%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	100,319,238	2.98%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,430,478	2.68%
	Reportos			274,594,029	8.15%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	274,594,029	8.15%
	TOTAL CARTERA			3,370,927,070	100.00%
	ACTIVO NETO			3,383,602,884	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.031 %
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."