

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				75,661,041	4.35%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,398,315	2.32%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,114,588	1.16%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,148,139	0.87%
Certificados Bursátiles Corporativos				849,350,035	48.82%
91	SALUD	21	HR A+	99,929,404	5.74%
91	GICSA	19	B/M	77,284,099	4.44%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,804,414	4.07%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,153,660	4.03%
91	AERMXCB	19	HR AA+	67,164,066	3.86%
91	GHEMA	23	HR A-	50,311,661	2.89%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,169,876	2.88%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,100,625	2.88%
91	LAB	23	AA (mex)	50,033,140	2.88%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	40,284,806	2.32%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,244,672	2.31%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,148,480	2.31%
91	SALUD	20	HR A+	30,508,128	1.75%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,593,000	1.70%
91	VASCONI	19	HR D	21,777,875	1.25%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,182,994	1.16%
91	VASCONI	22L	HR D	15,500,000	0.89%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,081,648	0.87%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	10,077,486	0.58%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Chequera Dolares				150,034,282	8.62%
CHD	40-110	1961770		137,236,674	7.89%
CHD	40-133	8035834		12,797,608	0.74%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				364,196,053	20.93%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	88,114,930	5.06%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	84,346,826	4.85%

D2SP	PEMEH20	251016	BBB	67,814,288	3.90%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	57,717,554	3.32%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	31,737,202	1.82%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	25,532,621	1.47%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	8,932,632	0.51%
Opciones CALL Divisas				771,764	0.04%
CALL	MXPUUSD	240814		771,764	0.04%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				191,508,253	11.01%
93	TPLAY	00124	HR2	50,147,534	2.88%
93	FINBE	00524	F1+ (mex)	30,198,365	1.74%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,422,445	1.29%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	17,961,981	1.03%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	14,871,662	0.86%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,782,147	0.74%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,022,634	0.58%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,682,205	0.50%
93	MINSA	00124	HR2	6,582,462	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,058,100	0.35%
93	LAB	00823	F1+ (mex)	6,052,967	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,725,752	0.33%
Reportos				108,397,263	6.23%
91	EDUCA	23L	HR AAA	64,251,847	3.69%
91	SIGMA	24-2	AAA (mex)	31,600,812	1.82%
91	HIR	22	HR AA-	12,544,604	0.72%
TOTAL CARTERA				1,739,918,691	100.00%
ACTIVO NETO				1,745,670,433	

Cartera al: 30/04/2024

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."

