

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|--|--------|------------|----------------------|---------------|
| | Certificados Bursátiles Bancarios | | | 186,222,439 | 5.52% |
| 94 | BMIFEL | 23V | AA (mex) | 62,195,728 | 1.84% |
| 94 | BACTIN | 23-3 | AA (mex) | 59,516,656 | 1.76% |
| 94 | BLADEX | 23 | AAA (mex) | 34,961,187 | 1.04% |
| 94 | BACTIN | 23 | AA (mex) | 29,548,866 | 0.88% |
| | Certificados Bursátiles Corporativos | | | 1,884,116,528 | 55.83% |
| 91 | LALA | 19-2 | AA (mex) | 150,758,415 | 4.47% |
| 91 | AB&CCB | 22 | AAA (mex) | 124,533,408 | 3.69% |
| 91 | CIRCLEK | 22 | HR A+ | 119,277,578 | 3.53% |
| 91 | ALSEA | 19 | A+ (mex) | 104,124,769 | 3.09% |
| 91 | VOLARCB | 23 | HR AA+ | 100,876,151 | 2.99% |
| 91 | ARA | 23X | mxAA- | 100,844,460 | 2.99% |
| 91 | FERROMX | 21-2 | AAA (mex) | 100,749,883 | 2.99% |
| 91 | DONDE | 23 | HR AA | 100,381,347 | 2.97% |
| 91 | FUNO | 23-2L | AAA (mex) | 100,236,469 | 2.97% |
| 91 | VIVAACB | 22L | HR AA+ | 91,496,890 | 2.71% |
| 91 | TPLAYCB | 20 | HR AA | 90,649,259 | 2.69% |
| 91 | LAB | 23-2 | AA+ (mex) | 90,414,144 | 2.68% |
| 91 | FUNO | 21-2X | AAA (mex) | 80,326,798 | 2.38% |
| 91 | FUNO | 23-3L | AAA (mex) | 75,563,402 | 2.24% |
| 91 | VINTE | 23X | HR AA- | 75,528,069 | 2.24% |
| 91 | TPLAY | 22 | HR A | 75,170,116 | 2.23% |
| 91 | SALUD | 20 | HR A+ | 74,183,972 | 2.20% |
| 91 | SALUD | 21 | HR A+ | 50,521,161 | 1.50% |
| 91 | BRX | 22-2 | AAA (mex) | 40,350,105 | 1.20% |
| 91 | DAIMLER | 23 | mxAAA | 40,299,831 | 1.19% |
| 91 | BEGRAND | 23 | HR A+ | 40,152,247 | 1.19% |
| 91 | CYDSASA | 23 | HR AA+ | 20,146,286 | 0.60% |
| 91 | HYCSA | 24 | HR AA | 20,007,624 | 0.59% |
| 91 | STORAGE | 21-2V | AA- (mex) | 17,524,146 | 0.52% |
| | Certificados De La Tesorería De La Federación | | | 291,309,564 | 8.63% |
| BI | CETES | 251224 | AAA(mex) | 272,258,708 | 8.07% |

| | | | | | |
|-----|--|---------|-----------|----------------------|----------------|
| BI | CETES | 240919 | AAA(mex) | 18,144,454 | 0.54% |
| BI | CETES | 240919 | AAA(mex) | 906,402 | 0.03% |
| | Chequera Dolares | | | 16,588,665 | 0.49% |
| CHD | 40-133 | 8355257 | | 16,588,665 | 0.49% |
| | Eurobonos de Empresas Privadas | | | 100,795,049 | 2.99% |
| D2 | GS227 | 240515 | BBB+ | 100,795,049 | 2.99% |
| | Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial | | | 108,926,912 | 3.23% |
| 93 | ELEKTRA | 00124 | HR1 | 100,103,290 | 2.97% |
| 93 | HYCSA | 00123 | HR2 | 8,823,622 | 0.26% |
| | Swaps Entregables | | | -3,910,200 | -0.12% |
| SWP | 2TIEMXP | 250207 | | -612,500 | -0.02% |
| SWP | 2TIEMXP | 240705 | | -745,000 | -0.02% |
| SWP | 2TIEMXP | 240802 | | -507,000 | -0.02% |
| SWP | 2TIEMXP | 240905 | | -30,000 | 0.00% |
| SWP | 2TIEMXP | 241111 | | -141,400 | 0.00% |
| SWP | 2TIEMXP | 260218 | | -2,339,500 | -0.07% |
| SWP | 2TIEMXP | 240926 | | 465,200 | 0.01% |
| | Títulos de Organismos Financieros Multilaterales | | | 123,705,722 | 3.67% |
| JI | CABEI | 1-23S | mxAAA | 123,705,722 | 3.67% |
| | Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal | | | 90,551,575 | 2.68% |
| 95 | CFE | 23-2X | AAA (mex) | 90,551,575 | 2.68% |
| | Reportos | | | 576,723,116 | 17.09% |
| LD | BONDESD | 240530 | AAA(mex) | 534,852,710 | 15.85% |
| LF | BONDESF | 240725 | AAA(mex) | 41,870,406 | 1.24% |
| | TOTAL CARTERA | | | 3,375,029,370 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 3,388,909,393 | |

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.035 %
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."