

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				75,789,323	4.41%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,365,324	2.35%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,285,785	1.18%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,138,214	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				819,237,477	47.67%
91	SALUD	21	HR A+	99,815,537	5.81%
91	GICSA	19	B/M	81,938,783	4.77%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,783,871	4.12%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,758,690	4.12%
91	AERMXCB	19	HR AA+	70,465,210	4.10%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,535,198	2.94%
91	LAB	23	AA (mex)	50,455,025	2.94%
91	GHEMA	23	HR A-	50,261,866	2.93%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,130,211	2.92%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	40,252,571	2.34%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,186,548	2.34%
91	SALUD	20	HR A+	30,488,222	1.77%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,567,596	1.72%
91	VASCONI	19	HR D	22,440,445	1.31%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,166,308	1.17%
91	VASCONI	22L	HR D	15,500,000	0.90%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,066,831	0.88%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	10,424,565	0.61%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Chequera Dolares				17,115,905	1.00%
CHD	40-110	1961770		16,623,591	0.97%
CHD	40-133	8035834		492,314	0.03%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				347,132,783	20.20%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	85,287,869	4.96%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	81,318,873	4.73%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	67,596,890	3.93%

D2SP	LIVEF61	261006	BBB	57,275,114	3.33%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	30,588,011	1.78%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	25,066,026	1.46%
Forward de Divisas				-1,992,396	-0.12%
FWD	MXPUSD	240412		-9,729,700	-0.57%
FWD	MXPUSD	240430		-2,638,296	-0.15%
FWD	MXPUSD	240430		-3,541,790	-0.21%
FWD	MXPUSD	240430		13,917,390	0.81%
Opciones CALL Divisas				376,036	0.02%
CALL	MXPUSD	240814		376,036	0.02%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				161,346,052	9.39%
93	TPLAY	00123	HR2	60,113,483	3.50%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,404,976	1.30%
93	FINBE	00324	HR1	15,155,762	0.88%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	14,726,630	0.86%
93	AMX	01224	F1+ (mex)	14,439,863	0.84%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,105,827	0.59%
93	MINSA	00124	HR2	6,577,127	0.38%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,053,249	0.35%
93	LAB	00823	F1+ (mex)	6,048,261	0.35%
93	SICREAC	00124	HR2	5,720,874	0.33%
Reportos				299,500,927	17.43%
91	MEGA	22-2	AAA (mex)	205,200,052	11.94%
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	94,300,875	5.49%
TOTAL CARTERA				1,718,506,107	100.00%
ACTIVO NETO				1,723,655,860	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.338 %

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."

