

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				75,663,468	4.27%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	40,478,771	2.29%
94	BACTIN	23	AA (mex)	20,070,717	1.13%
94	BACTIN	21	AA (mex)	15,113,980	0.85%
Certificados Bursátiles Corporativos				766,595,477	43.28%
91	SALUD	21	HR A+	99,740,006	5.63%
91	GICSA	19	B/M	79,356,675	4.48%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	70,708,987	3.99%
91	LALA	19-2	AA (mex)	70,686,725	3.99%
91	AERMxcb	19	HR AA+	60,183,512	3.40%
91	HERDEZ	20-2	AA (mex)	50,464,175	2.85%
91	LAB	23	AA (mex)	50,395,742	2.85%
91	GHEMA	23	HR A-	50,194,582	2.83%
91	DAIMLER	23	mxAAA	50,071,838	2.83%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,265,169	2.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	40,015,831	2.26%
91	SALUD	20	HR A+	30,421,083	1.72%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	29,529,445	1.67%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	20,142,203	1.14%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	15,046,663	0.85%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	9,372,842	0.53%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
Chequera Dolares				54,191,290	3.06%
CHD	40-110	1961770		36,821,509	2.08%
CHD	40-133	8035834		17,369,782	0.98%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				393,573,300	22.22%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	93,560,982	5.28%
D2SP	PEMEB68	260804	BBB	92,409,004	5.22%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	74,012,443	4.18%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	62,482,389	3.53%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	34,245,860	1.93%

D2SP	LIVEE96	241002	BBB	27,616,618	1.56%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	9,246,004	0.52%
Forward de Divisas				5,425,635	0.31%
FWD	MXPUSD	240821		-2,846,865	-0.16%
FWD	MXPUSD	240821		8,272,500	0.47%
Opciones CALL Divisas				2,170,856	0.12%
CALL	MXPUSD	240814		2,170,856	0.12%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				293,786,913	16.59%
93	TPLAY	00124	HR2	50,025,148	2.83%
93	FINBE	00824	HR1	40,012,647	2.26%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	28,733,957	1.62%
93	PCARFM	02124	F1+ (mex)	28,637,747	1.62%
93	AMX	07824	F1+ (mex)	25,743,767	1.45%
93	LAB	00124	F1+ (mex)	22,380,327	1.26%
93	AMX	04224	F1+ (mex)	18,246,239	1.03%
93	AMX	04624	F1+ (mex)	12,984,742	0.73%
93	AMX	07524	F1+ (mex)	12,499,090	0.71%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,164,367	0.63%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,003,182	0.57%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,684,880	0.49%
93	SICREAC	00224	HR2	8,005,439	0.45%
93	MINSA	00124	HR2	6,571,413	0.37%
93	ALMER	00224	F1 (mex)	6,046,253	0.34%
93	AMX	05824	F1+ (mex)	4,047,716	0.23%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deu				110,157,515	6.22%
51	ACTICOB	FF	HR AAA	110,157,515	6.22%
Reportos				69,518,020	3.93%
91	EDUCA	23L	HR AAA	40,104,095	2.26%
91	EDUCA	23-2L	HR AAA	29,102,712	1.64%
91	HIR	22	HR AA-	311,214	0.02%
TOTAL CARTERA				1,771,082,474	100.00%
ACTIVO NETO				1,778,215,965	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 1.500 % Var Promedio: 0.272 %
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."