

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			96,749,759	1.37%
CD	NAFF	250307	AAA (mex)	96,749,759	1.37%
	Certificados Bursátiles Bancarios			316,131,358	4.47%
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,145,876	2.85%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	64,319,066	0.91%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,666,416	0.72%
	Certificados Bursátiles Corporativos			3,126,490,853	44.25%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	249,797,139	3.54%
91	TPLAYCB	20	HR AA	224,127,442	3.17%
91	AERMxcb	19	HR AA+	174,626,572	2.47%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	164,195,061	2.32%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	131,640,066	1.86%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	131,189,461	1.86%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,006,888	1.76%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,200,734	1.70%
91	NM	24	mxAA+	100,325,656	1.42%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,292,126	1.42%
91	DONDE	23	HR AA	100,090,396	1.42%
91	SALUD	21	HR A+	99,929,404	1.41%
91	GAP	21	mxAAA	92,179,417	1.30%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	90,633,050	1.28%
91	ARA	23X	mxAA-	90,484,109	1.28%
91	LALA	19-2	AA (mex)	88,090,806	1.25%
91	GICSA	19	B/M	85,012,509	1.20%
91	SALUD	20	HR A+	81,355,009	1.15%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,346,492	1.07%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,285,914	1.07%
91	TPLAY	22	HR A	74,950,063	1.06%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,691,073	0.92%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,099,464	0.85%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	59,982,472	0.85%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,621,092	0.83%

91	ALSEA	19	A+ (mex)	50,356,008	0.71%
91	GHEMA	23	HR A-	50,311,661	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	42,382,473	0.60%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,523,942	0.57%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,030,686	0.57%
91	LAB	23	AA (mex)	35,023,198	0.50%
91	GICSA	17	B/M	32,942,074	0.47%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,163,297	0.43%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,083,975	0.36%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,992,274	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,160,824	0.29%
91	GAP	20	mxAAA	11,328,922	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	10,039,107	0.14%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,270,749,608	17.98%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	721,764,600	10.21%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	524,196,125	7.42%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	24,788,883	0.35%
	Chequera Dolares			12,291,355	0.17%
CHD	40-133	8034399		12,291,355	0.17%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,503,352	1.42%
D2	GS227	240515	BBB+	100,503,352	1.42%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			321,730,473	4.55%
93	ELEKTRA	00124	HR1	120,953,844	1.71%
93	TPLAY	00124	HR2	100,295,068	1.42%
93	DONDE	00124	HR1	50,234,534	0.71%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,034,473	0.21%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,967,113	0.20%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	12,357,382	0.18%
93	HYCSA	00123	HR2	8,888,060	0.13%
	Swaps Entregables			-33,973,250	-0.48%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,327,500	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240802		-737,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-4,942,000	-0.07%
SWP	2TIEMXP	250815		-4,437,000	-0.06%
SWP	2TIEMXP	241111		-226,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-9,977,250	-0.14%
SWP	2TIEMXP	260317		-12,742,000	-0.18%
SWP	2TIEMXP	240926		416,000	0.01%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			423,314,199	5.99%
95	PEMEX	19	mxAAA	207,352,193	2.93%

95	FNCOT	21G	AAA (mex)	125,649,454	1.78%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,312,553	1.28%
	Reportos			1,432,324,596	20.27%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	1,432,324,596	20.27%
	TOTAL CARTERA			7,066,312,303	100.00%
	ACTIVO NETO			7,092,336,001	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.300 % **Var Promedio:** 0.080 %
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."