

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
HR Ratings de México, S.A. De C.V.
Categoría: Discrecional Deuda

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				30,917,736	6.53%
94	BANORTE	23-4	mxAAA	10,083,778	2.13%
94	BLADDEX	21	AAA (mex)	10,752,962	2.27%
94	SCOTIAB	23	AAA (mex)	10,080,996	2.13%
Certificados Bursátiles Corporativos				160,638,460	33.91%
91	AMX	22	AAA (mex)	10,022,382	2.12%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,039,625	3.18%
91	BACHOCO	22	AAA (mex)	10,035,245	2.12%
91	ECREDCB	22	mxAAA	10,071,435	2.13%
91	FEMSA	22L	AAA (mex)	10,064,370	2.12%
91	GAP	19	mxAAA	15,028,108	3.17%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	10,016,550	2.11%
91	GPH	22	AAA (mex)	10,076,542	2.13%
91	GRUMA	22	mxAA+	10,091,229	2.13%
91	KIMBER	22-2	AAA (mex)	10,036,063	2.12%
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	9,867,268	2.08%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,136,234	3.20%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,065,778	3.18%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	10,087,631	2.13%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				0	0.00%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				45,184,840	9.54%
1ISP	FRMXNX	N	NO APLICA	34,314,750	7.24%
1ISP	IB1MXX	N	NO APLICA	10,870,090	2.29%
Udibonos				26,178,792	5.53%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	26,178,792	5.53%
Certificados De La Tesorería De La Federación				40,392,764	8.53%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,210,385	1.94%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	18,131,252	3.83%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	13,051,127	2.76%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				26,359,290	5.56%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	26,359,290	5.56%
Reportos				144,086,856	30.41%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	144,086,856	30.41%
TOTAL CARTERA				473,758,736	100.00%
ACTIVO NETO				473,503,060	
Cartera al:		29/Dic/2023			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.0570%
Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.
El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.
***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.**
Límite autorizado por CNBV