

## MEDIANO PLAZO GENERAL

### HR Ratings de México, S.A. De C.V.

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>754,541,640</b>
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	754,541,640
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>4,758,375,747</b>
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,357,215,719
M	BONOS	270603	AAA(mex)	1,351,633,733
M	BONOS	240905	AAA(mex)	1,169,285,860
M	BONOS	260305	AAA(mex)	649,670,217
M	BONOS	270304	AAA(mex)	135,237,009
M	BONOS	250306	AAA(mex)	95,333,210
	<b>Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Mensual De Inte</b>			<b>652,593,468</b>
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	652,593,468
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>1,477,541,766</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	836,520,980
CD	KDB	22V	AAA (mex)	565,367,028
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,653,759
	<b>Certificados de Depósito</b>			<b>1,145,910,885</b>
F	BMULTIV	23048	mxA-2	502,706,600
F	BMULTIV	23061	mxA-2	352,584,050
F	BMULTIV	23031	mxA-2	290,620,235
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>2,107,997,030</b>
94	BACTIN	22	AA (mex)	450,500,175
94	BACTIN	23	AA (mex)	405,065,660
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	404,387,420
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,009,372
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,294,891
94	BACTIN	21	AA (mex)	231,739,513
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>4,650,975,376</b>
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	656,950,997
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	421,692,273
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	403,343,416
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	364,943,676

91	ORBIA	22L	AAA (mex)	353,081,595
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	250,523,885
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	247,605,466
91	NM	24	mxAA+	203,555,236
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	181,945,805
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	161,626,941
91	LALA	19-2	AA (mex)	160,181,212
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	150,992,525
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	143,318,029
91	FINN	18	A- (mex)	131,326,366
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,280,708
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	97,018,384
91	DAIMLER	23	mxAAA	86,805,387
91	LAB	23	AA (mex)	85,953,767
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,857,938
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,277,580
91	GCARSO	23	AAA (mex)	57,897,508
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,265,325
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,125,434
91	VOLARCB	21L	HR AA+	45,958,330
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,482,190
91	AERMxcb	19	HR AA+	33,695,337
91	GAP	21V	mxAAA	15,127,629
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,142,436

**Certificados De La Tesorería De La Federación**

**18,038,418,254**

BI	CETES	240516	AAA(mex)	1,772,752,140
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,752,223,057
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,692,774,461
BI	CETES	240502	AAA(mex)	1,475,441,271
BI	CETES	240822	AAA(mex)	1,434,456,700
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,398,715,521
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,243,963,205
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,110,930,269
BI	CETES	240725	AAA(mex)	944,105,620
BI	CETES	240808	AAA(mex)	864,138,060
BI	CETES	250710	AAA(mex)	846,981,463
BI	CETES	250123	AAA(mex)	732,120,240
BI	CETES	240411	AAA(mex)	587,251,909
BI	CETES	250306	AAA(mex)	586,937,652
BI	CETES	240418	AAA(mex)	496,661,350
BI	CETES	260219	AAA(mex)	330,808,040
BI	CETES	240905	AAA(mex)	319,932,950
BI	CETES	241128	AAA(mex)	185,887,600
BI	CETES	240613	AAA(mex)	129,870,976
BI	CETES	240530	AAA(mex)	112,370,691
BI	CETES	240725	AAA(mex)	20,095,080

**Chequera Euros**

**50,937**

CHE	40-012	5500702		50,937
-----	--------	---------	--	--------

	<b>Chequera Dolares</b>			<b>310,265,184</b>
CHD	40-133	8035859		310,265,184
	<b>Títulos Emisoras Extranjeras SIC</b>			<b>602,066,910</b>
D8	CAF0627	90	AA-	401,730,641
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,336,268
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>303,816,755</b>
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	169,224,030
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	134,592,725
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>657,466,814</b>
D2	GS227	240515	BBB+	300,801,168
D2	CAF872	310222	AA-	253,471,032
D2	KEXIM	250426	AA	103,194,614
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>135,578,110</b>
93	TPLAY	00223	HR2	100,505,166
93	ALMER	00223	F1 (mex)	20,006,612
93	MINSA	00124	HR2	15,066,332
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-14,935,840</b>
SWP	2TIEMXP	240724		-8,563,040
SWP	2TIEMXP	241025		-6,200,800
SWP	2TIEMXP	240802		-379,000
SWP	2TIEMXP	250207		207,000
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>533,704,467</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	433,216,615
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,487,852
	<b>Udibonos</b>			<b>991,226,978</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	847,208,753
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	144,018,225
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,639,723,848</b>
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	423,323,275
95	PEMEX	13-2	mxAAA	413,056,208
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	350,621,611
95	PEMEX	19	mxAAA	252,448,523
95	CFE	21-2	AAA (mex)	121,306,076
95	FEFA	23G	mxAAA	78,968,155
	<b>Reportos</b>			<b>1,835,030,625</b>
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	1,634,969,299
LF	BONDESF	261022	AAA(mex)	100,030,673
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	100,030,654
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>8,313,032,032</b>

LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	2,518,073,200
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,607,856,336
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	1,511,295,930
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	701,420,300
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	604,466,412
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	500,666,845
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	499,944,835
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	369,308,174
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>48,893,380,986</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>48,557,521,822</b>

**Cartera al: 26/03/2024**

---

**Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.034 %**  
**Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y c**  
**observaciones.**

---

**"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por lo que pueden afectar al instrumento de forma simultánea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores. Esto implica que el riesgo asociado es alto."**

---

---

---

**AAA/3CP**

---

%

---

**1.54%**

1.54%

**9.73%**

2.78%

2.76%

2.39%

1.33%

0.28%

0.20%

**1.34%**

1.34%

**3.02%**

1.71%

1.16%

0.16%

**2.34%**

1.03%

0.72%

0.59%

**4.31%**

0.92%

0.83%

0.83%

0.74%

0.52%

0.47%

**9.51%**

1.34%

0.86%

0.83%

0.75%

0.72%  
0.51%  
0.51%  
0.42%  
0.37%  
0.33%  
0.33%  
0.31%  
0.29%  
0.27%  
0.21%  
0.20%  
0.18%  
0.18%  
0.17%  
0.12%  
0.12%  
0.11%  
0.10%  
0.09%  
0.08%  
0.07%  
0.03%  
0.02%

**36.89%**

3.63%  
3.58%  
3.46%  
3.02%  
2.93%  
2.86%  
2.54%  
2.27%  
1.93%  
1.77%  
1.73%  
1.50%  
1.20%  
1.20%  
1.02%  
0.68%  
0.65%  
0.38%  
0.27%  
0.23%  
0.04%

**0.00%**

0.00%

**0.64%**  
0.64%

**1.23%**  
0.82%  
0.41%

**0.62%**  
0.35%  
0.28%

**1.35%**  
0.62%  
0.52%  
0.21%

**0.28%**  
0.21%  
0.04%  
0.03%

**-0.03%**  
-0.02%  
-0.01%  
0.00%  
0.00%

**1.09%**  
0.89%  
0.21%

**2.03%**  
1.73%  
0.30%

**3.35%**  
0.87%  
0.85%  
0.72%  
0.52%  
0.25%  
0.16%

**3.75%**  
3.34%  
0.21%  
0.21%

**17.00%**

5.15%  
3.29%  
3.09%  
1.44%  
1.24%  
1.02%  
1.02%  
0.76%

**100.00%**

---

on una muestra de 252

---

**ios y valores  
acto negativo debido  
alguno de los  
ido a que los factores  
encionar algunos  
valores, lo anterior**

---