

## MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>8,567,505,660</b>	<b>18.04%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	3,277,884,794	6.90%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	2,289,748,133	4.82%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,985,907,154	4.18%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	693,103,245	1.46%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	133,393,037	0.28%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	95,888,663	0.20%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	91,580,635	0.19%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>1,478,039,309</b>	<b>3.11%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	836,815,589	1.76%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	565,610,245	1.19%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,613,475	0.16%
	<b>Certificados de Depósito</b>			<b>1,146,456,368</b>	<b>2.41%</b>
F	BMULTIV	23048	mxA-2	502,945,875	1.06%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	352,751,728	0.74%
F	BMULTIV	23031	mxA-2	290,758,765	0.61%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>2,105,192,549</b>	<b>4.43%</b>
94	BACTIN	22	AA (mex)	450,727,974	0.95%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	404,535,416	0.85%
94	BACTIN	23	AA (mex)	401,517,328	0.85%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,182,402	0.76%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,414,435	0.54%
94	BACTIN	21	AA (mex)	231,814,994	0.49%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>4,629,617,937</b>	<b>9.75%</b>
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	657,032,809	1.38%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	421,883,751	0.89%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	403,512,100	0.85%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,104,230	0.77%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,055,545	0.74%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	250,647,315	0.53%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	247,466,824	0.52%
91	NM	24	mxAA+	203,651,648	0.43%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	181,951,387	0.38%
91	LALA	19-2	AA (mex)	160,233,635	0.34%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	155,581,537	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,066,530	0.32%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	140,625,580	0.30%
91	FINN	18	A- (mex)	125,404,768	0.26%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,148,378	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,075,718	0.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	86,845,744	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	85,994,415	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,832,177	0.17%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,305,546	0.13%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	57,944,427	0.12%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,103,140	0.12%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,155,161	0.11%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	44,411,920	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,214,733	0.09%
91	AERMxCB	19	HR AA+	32,105,447	0.07%
91	GAP	21V	mxAAA	15,119,688	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,143,787	0.02%

**Certificados De La Tesorería De La Federación**

**16,211,161,324**

**34.14%**

BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,764,832,457	3.72%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,703,495,414	3.59%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,627,970,704	3.43%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	1,447,191,733	3.05%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,396,461,903	2.94%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,354,051,800	2.85%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,254,297,617	2.64%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	958,410,680	2.02%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	871,843,320	1.84%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	849,346,001	1.79%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	736,917,200	1.55%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	590,373,413	1.24%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	445,504,914	0.94%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	441,539,520	0.93%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	322,747,186	0.68%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	187,290,460	0.39%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	131,060,488	0.28%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	113,403,594	0.24%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	14,422,920	0.03%

**Chequera Euros**

**52,154**

**0.00%**

CHE	40-012	5500702		52,154	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

	<b>Chequera Dolares</b>			<b>165,728,296</b>	<b>0.35%</b>
CHD	40-133	8035859		165,728,296	0.35%
	<b>Títulos Emisoras Extranjeras SIC</b>			<b>597,096,005</b>	<b>1.26%</b>
D8	CAF0627	90	AA-	396,639,235	0.84%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,456,771	0.42%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>643,443,140</b>	<b>1.36%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	344,520,875	0.73%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	166,511,320	0.35%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	132,410,945	0.28%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>650,882,304</b>	<b>1.37%</b>
D2	GS227	240515	BBB+	300,916,355	0.63%
D2	CAF872	310222	AA-	246,165,876	0.52%
D2	KEXIM	250426	AA	103,800,073	0.22%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>130,642,633</b>	<b>0.28%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	100,557,796	0.21%
93	MINSA	00124	HR2	15,073,622	0.03%
93	TPLAY	00124	HR2	15,011,215	0.03%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-14,960,050</b>	<b>-0.03%</b>
SWP	2TIEMXP	240724		-6,948,750	-0.02%
SWP	2TIEMXP	241025		-6,183,550	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-357,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,470,750	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>533,493,995</b>	<b>1.12%</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	432,959,767	0.91%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,534,228	0.21%
	<b>Udibonos</b>			<b>1,267,083,373</b>	<b>2.67%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	842,400,447	1.77%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	424,682,926	0.89%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,643,539,325</b>	<b>3.46%</b>
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	424,492,656	0.89%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	416,542,792	0.88%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	350,783,941	0.74%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,481,875	0.53%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,224,542	0.25%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,013,520	0.17%
	<b>Reportos</b>			<b>651,217,878</b>	<b>1.37%</b>
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	197,234,314	0.42%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	110,129,711	0.23%

LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	100,030,498	0.21%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	92,089,288	0.19%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	84,992,368	0.18%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	51,703,590	0.11%
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	15,038,110	0.03%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>7,078,226,578</b>	<b>14.91%</b>
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	2,497,940,375	5.26%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,608,809,568	3.39%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	799,711,552	1.68%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	701,983,170	1.48%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	599,726,244	1.26%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	500,400,220	1.05%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	369,655,449	0.78%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>47,484,418,778</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>47,472,506,534</b>	

Cartera al: 25/04/2024

**Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.046 %**  
**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."