

MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			8,462,465,699	17.32%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	3,271,127,174	6.69%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	2,194,512,232	4.49%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,982,839,205	4.06%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	693,239,258	1.42%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	133,440,008	0.27%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	95,666,956	0.20%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	91,640,868	0.19%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,474,798,108	3.02%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	834,987,542	1.71%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	564,361,110	1.16%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,449,456	0.15%
	Certificados de Depósito			1,143,841,141	2.34%
F	BMULTIV	23048	mxA-2	501,798,600	1.03%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	351,947,148	0.72%
F	BMULTIV	23031	mxA-2	290,095,393	0.59%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,103,514,587	4.30%
94	BACTIN	22	AA (mex)	449,674,529	0.92%
94	BACTIN	23	AA (mex)	403,753,436	0.83%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	403,608,756	0.83%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	360,354,913	0.74%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	254,839,087	0.52%
94	BACTIN	21	AA (mex)	231,283,867	0.47%
	Certificados Bursátiles Corporativos			4,636,017,243	9.49%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	655,693,104	1.34%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	420,902,826	0.86%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	402,572,316	0.82%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	364,303,377	0.75%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	351,977,068	0.72%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	252,472,928	0.52%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	246,830,419	0.51%
91	NM	24	mxAA+	205,080,466	0.42%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	181,478,767	0.37%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,876,157	0.33%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	155,478,475	0.32%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	150,710,337	0.31%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	140,554,785	0.29%
91	FINN	18	A- (mex)	129,490,226	0.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	101,137,884	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,670,391	0.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,453,588	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	85,796,783	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,626,226	0.17%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,163,934	0.12%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	57,815,241	0.12%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,096,538	0.11%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,019,061	0.10%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	46,343,820	0.10%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,238,506	0.08%
91	AERMxcb	19	HR AA+	32,026,620	0.07%
91	GAP	21V	mxAAA	15,086,076	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,121,327	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

15,741,614,075

32.21%

BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,761,845,483	3.61%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,700,572,767	3.48%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,624,735,214	3.32%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	1,444,064,272	2.96%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,394,851,415	2.85%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,351,836,300	2.77%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,251,763,178	2.56%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	956,384,768	1.96%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	869,959,530	1.78%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	848,074,002	1.74%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	735,690,080	1.51%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	589,341,102	1.21%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	445,160,448	0.91%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	322,048,440	0.66%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	186,959,780	0.38%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	130,772,689	0.27%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	113,162,175	0.23%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	14,392,432	0.03%

Chequera Euros

51,269

0.00%

CHE	40-012	5500702		51,269	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

Chequera Dolares

334,776,230

0.69%

CHD	40-133	8035859		334,776,230	0.69%
Títulos Emisoras Extranjeras SIC				598,554,003	1.23%
D8	CAF0627	90	AA-	396,677,007	0.81%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	201,876,996	0.41%
Titulos de Credito Extranjeros				643,557,828	1.32%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	344,310,454	0.70%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	166,666,260	0.34%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	132,581,114	0.27%
Eurobonos de Empresas Privadas				650,070,110	1.33%
D2	GS227	240515	BBB+	300,225,485	0.61%
D2	CAF872	310222	AA-	246,292,432	0.50%
D2	KEXIM	250426	AA	103,552,194	0.21%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				135,509,727	0.28%
93	TPLAY	00223	HR2	100,313,950	0.21%
93	ALMER	00223	F1 (mex)	20,156,541	0.04%
93	MINSA	00124	HR2	15,039,236	0.03%
Swaps Entregables				-14,164,990	-0.03%
SWP	2TIEMXP	240724		-6,878,990	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241025		-6,043,250	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-330,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		-912,750	0.00%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				532,331,103	1.09%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	432,020,475	0.88%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,310,628	0.21%
Udibonos				1,376,428,758	2.82%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	1,237,442,198	2.53%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	138,986,560	0.28%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				1,644,459,317	3.37%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	423,532,607	0.87%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	416,084,336	0.85%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	353,206,294	0.72%
95	PEMEX	19	mxAAA	251,889,543	0.52%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,906,630	0.25%
95	FEFA	23G	mxAAA	78,839,907	0.16%
Reportos				1,608,236,533	3.29%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	501,550,442	1.03%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	275,700,346	0.56%
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	213,428,643	0.44%

LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	200,061,098	0.41%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	180,028,753	0.37%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	85,775,015	0.18%
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	70,286,840	0.14%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	67,149,948	0.14%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	14,255,448	0.03%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				7,801,824,946	15.96%
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	2,514,814,325	5.15%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,605,339,824	3.29%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	1,509,427,290	3.09%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	700,426,279	1.43%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	603,702,216	1.24%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	499,292,345	1.02%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	368,822,667	0.76%
TOTAL CARTERA				48,873,885,687	100.00%
ACTIVO NETO				47,873,266,124	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.044 %
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."