

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>				<b>317,755,676</b>	<b>4.48%</b>
94	BACTIN	23	AA (mex)	202,857,854	2.86%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	64,266,540	0.91%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,631,283	0.71%
<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>				<b>3,194,705,203</b>	<b>45.07%</b>
91	TPLAYCB	20	HR AA	262,298,508	3.70%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	252,041,139	3.56%
91	AERMxcb	19	HR AA+	183,209,546	2.59%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	164,064,062	2.32%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	131,633,631	1.86%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	131,081,003	1.85%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,030,569	1.75%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,082,955	1.69%
91	DONDE	23	HR AA	100,866,667	1.42%
91	NM	24	mxAA+	100,245,355	1.41%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,194,398	1.41%
91	SALUD	21	HR A+	99,815,537	1.41%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	93,754,543	1.32%
91	GAP	21	mxAAA	92,248,044	1.30%
91	ARA	23X	mxAA-	90,403,443	1.28%
91	GICSA	19	B/M	90,132,661	1.27%
91	LALA	19-2	AA (mex)	88,033,919	1.24%
91	SALUD	20	HR A+	81,301,926	1.15%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,283,854	1.06%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,213,159	1.06%
91	TPLAY	22	HR A	74,847,652	1.06%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,642,511	0.91%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,156,450	0.85%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	59,930,980	0.85%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	59,124,246	0.83%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	50,315,714	0.71%
91	GHEMA	23	HR A-	50,261,866	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	42,356,814	0.60%

91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,507,540	0.57%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,419,882	0.57%
91	GICSA	17	B/M	35,979,080	0.51%
91	LAB	23	AA (mex)	35,318,518	0.50%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,133,663	0.43%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,065,235	0.35%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,974,602	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,141,154	0.28%
91	GAP	20	mxAAA	11,331,252	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	10,064,289	0.14%
91	CADU	19	HR BBB	7,198,839	0.10%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>1,264,891,840</b>	<b>17.85%</b>
BI	CETES	240905	AAA(mex)	715,182,975	10.09%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	525,154,188	7.41%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	21,444,562	0.30%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,110,115	0.04%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>28,424,885</b>	<b>0.40%</b>
CHD	40-133	8034399		28,424,885	0.40%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>				<b>100,431,724</b>	<b>1.42%</b>
D2	GS227	240515	BBB+	100,431,724	1.42%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>436,759,225</b>	<b>6.16%</b>
93	TPLAY	00123	HR2	200,378,276	2.83%
93	ELEKTRA	00124	HR1	120,850,304	1.71%
93	DONDE	00124	HR1	50,193,265	0.71%
93	LAB	00423	F1+ (mex)	26,267,550	0.37%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,161,143	0.21%
93	ALMER	00223	F1 (mex)	15,029,322	0.21%
93	HYCSA	00123	HR2	8,879,364	0.13%
<b>Swaps Entregables</b>				<b>-5,994,400</b>	<b>-0.09%</b>
SWP	2TIEMXP	240419		-959,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240422		-821,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-775,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-1,842,500	-0.03%
SWP	2TIEMXP	250815		-1,817,500	-0.03%
SWP	2TIEMXP	260218		-876,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240926		683,600	0.01%
SWP	2TIEMXP	260317		241,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		106,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		65,500	0.00%
<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>				<b>425,054,886</b>	<b>6.00%</b>

95	PEMEX	19	mxAAA	207,341,487	2.93%
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	126,681,864	1.79%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	91,031,535	1.28%
	<b>Reportos</b>			<b>1,325,860,926</b>	<b>18.71%</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,325,860,926	18.71%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,087,889,965</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,129,900,257</b>	

**Cartera al:** 27/03/2024

**Límite Máximo de VaR:** 0.300 % **Var Promedio:** 0.079 %  
**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."**