

**MEDIANO PLAZO**

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			96,434,404	1.37%
CD	NAFF	250307	AAA (mex)	96,434,404	1.37%
	Certificados Bursátiles Bancarios			316,365,103	4.50%
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,876,718	2.87%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	64,037,291	0.91%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,451,095	0.72%
	Certificados Bursátiles Corporativos			3,148,362,863	44.75%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	251,143,305	3.57%
91	TPLAYCB	20	HR AA	243,574,027	3.46%
91	AERMxcb	19	HR AA+	173,830,982	2.47%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	163,518,656	2.32%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	131,017,617	1.86%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	130,615,625	1.86%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,415,210	1.75%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,600,033	1.70%
91	NM	24	mxAA+	100,832,781	1.43%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,779,534	1.43%
91	DONDE	23	HR AA	100,637,004	1.43%
91	SALUD	21	HR A+	100,496,392	1.43%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	94,369,484	1.34%
91	GAP	21	mxAAA	91,909,479	1.31%
91	ARA	23X	mxAA-	90,063,968	1.28%
91	LALA	19-2	AA (mex)	87,726,210	1.25%
91	GICSA	19	B/M	84,699,489	1.20%
91	SALUD	20	HR A+	80,957,737	1.15%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,741,878	1.08%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,729,222	1.08%
91	TPLAY	22	HR A	75,376,124	1.07%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,411,571	0.92%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,558,533	0.86%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	59,708,954	0.85%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,915,521	0.84%

91	ALSEA	19	A+ (mex)	50,136,612	0.71%
91	GHEMA	23	HR A-	50,058,379	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	42,250,380	0.60%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,328,615	0.57%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,259,217	0.57%
91	LAB	23	AA (mex)	35,196,123	0.50%
91	GICSA	17	B/M	32,809,832	0.47%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,011,436	0.43%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,208,489	0.36%
91	CYDSASA	23	HR AA+	21,102,838	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,061,138	0.29%
91	GAP	20	mxAAA	11,292,919	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	10,017,552	0.14%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,266,512,383	18.00%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	718,858,125	10.22%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	522,964,688	7.43%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	21,562,369	0.31%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,127,201	0.04%
	Chequera Dolares			12,240,391	0.17%
CHD	40-133	8034399		12,240,391	0.17%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,075,162	1.42%
D2	GS227	240515	BBB+	100,075,162	1.42%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			425,025,955	6.04%
93	TPLAY	00123	HR2	201,633,374	2.87%
93	ELEKTRA	00124	HR1	120,413,924	1.71%
93	DONDE	00124	HR1	50,016,475	0.71%
93	ALMER	00223	F1 (mex)	15,117,406	0.22%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,088,566	0.21%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,910,035	0.20%
93	HYCSA	00123	HR2	8,846,175	0.13%
	Swaps Entregables			-28,923,350	-0.41%
SWP	2TIEMXP	240419		-964,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240422		-825,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250207		-912,750	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-660,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-4,611,000	-0.07%
SWP	2TIEMXP	250815		-4,019,500	-0.06%
SWP	2TIEMXP	241111		-216,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-7,672,500	-0.11%
SWP	2TIEMXP	260317		-9,486,000	-0.14%
SWP	2TIEMXP	240926		444,400	0.01%

	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			423,558,542	6.02%
95	PEMEX	19	mxAAA	206,549,425	2.94%
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	126,252,129	1.79%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,756,987	1.29%
	Reportos			1,276,356,465	18.14%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,276,356,465	18.14%
	TOTAL CARTERA			7,036,007,918	100.00%
	ACTIVO NETO			7,073,487,571	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.300 % Var Promedio: 0.080 %
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."