

## 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>8,580,619,898</b>	<b>18.27%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	3,284,328,714	6.99%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	2,290,583,892	4.88%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,989,967,537	4.24%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	694,316,835	1.48%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	133,549,455	0.28%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	96,096,904	0.21%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	91,776,561	0.20%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>1,480,237,885</b>	<b>3.15%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	838,386,373	1.79%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	566,683,695	1.21%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,167,817	0.16%
	<b>Certificados de Depósito</b>			<b>1,145,491,160</b>	<b>2.44%</b>
F	BMULTIV	23048	mxA-2	503,931,320	1.07%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	350,230,979	0.75%
F	BMULTIV	23031	mxA-2	291,328,861	0.62%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>2,109,330,137</b>	<b>4.49%</b>
94	BACTIN	22	AA (mex)	451,633,307	0.96%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	405,331,328	0.86%
94	BACTIN	23	AA (mex)	402,291,752	0.86%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,893,467	0.77%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,908,820	0.55%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,271,464	0.50%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>4,627,227,632</b>	<b>9.85%</b>
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	652,178,487	1.39%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	418,799,375	0.89%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	404,319,208	0.86%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,791,949	0.78%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,731,821	0.75%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	251,154,973	0.54%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	248,013,775	0.53%
91	NM	24	mxAA+	204,049,041	0.43%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,357,741	0.39%
91	LALA	19-2	AA (mex)	160,540,614	0.34%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	155,418,746	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,372,455	0.32%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	140,810,599	0.30%
91	FINN	18	A- (mex)	125,505,349	0.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,371,199	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,280,886	0.21%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,014,632	0.19%
91	LAB	23	AA (mex)	85,375,249	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	81,009,271	0.17%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,427,210	0.13%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	58,055,425	0.12%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,215,089	0.12%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,272,162	0.11%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	44,508,899	0.10%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,288,454	0.09%
91	AERMxCB	19	HR AA+	32,173,200	0.07%
91	GAP	21V	mxAAA	15,028,741	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,163,084	0.02%

**Certificados De La Tesorería De La Federación**

**16,910,807,646**

**36.01%**

BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,767,933,529	3.76%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,706,329,677	3.63%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,630,894,576	3.47%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	1,449,939,476	3.09%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,398,135,905	2.98%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,355,983,800	2.89%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,256,532,113	2.68%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	960,228,623	2.04%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	873,523,980	1.86%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	850,884,673	1.81%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	738,154,640	1.57%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	672,492,075	1.43%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	591,349,286	1.26%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	446,139,468	0.95%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	441,944,699	0.94%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	323,350,541	0.69%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	187,621,820	0.40%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	131,301,125	0.28%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	113,617,364	0.24%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	14,450,277	0.03%

**Chequera Euros**

**51,703**

**0.00%**

CHE	40-012	5500702		51,703	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

	<b>Chequera Dolares</b>			<b>68,985,846</b>	<b>0.15%</b>
CHD	40-133	8035859		68,985,846	0.15%
	<b>Títulos Emisoras Extranjeras SIC</b>			<b>597,662,426</b>	<b>1.27%</b>
D8	CAF0627	90	AA-	396,804,178	0.85%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,858,248	0.43%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>644,956,760</b>	<b>1.37%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	345,257,823	0.74%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	166,995,485	0.36%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	132,703,452	0.28%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>647,233,694</b>	<b>1.38%</b>
D2	GS227	240515	BBB+	301,510,057	0.64%
D2	CAF872	310222	AA-	246,723,875	0.53%
D2	KEXIM	250426	AA	98,999,762	0.21%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>130,914,716</b>	<b>0.28%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	100,767,293	0.22%
93	MINSA	00124	HR2	15,103,163	0.03%
93	TPLAY	00124	HR2	15,044,260	0.03%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-14,870,680</b>	<b>-0.03%</b>
SWP	2TIEMXP	240724		-6,972,730	-0.02%
SWP	2TIEMXP	241025		-6,201,950	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-368,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,327,500	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>531,350,792</b>	<b>1.13%</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	430,624,506	0.92%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,726,286	0.21%
	<b>Udibonos</b>			<b>1,267,804,580</b>	<b>2.70%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	841,176,359	1.79%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	426,628,221	0.91%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,643,357,729</b>	<b>3.50%</b>
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	421,458,580	0.90%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	417,950,266	0.89%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	351,457,271	0.75%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,868,528	0.54%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,460,885	0.26%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,162,200	0.17%
	<b>Reportos</b>			<b>906,160,500</b>	<b>1.93%</b>
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	364,905,550	0.78%

IS	BPA182	260219	AAA(mex)	197,295,179	0.42%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	100,061,495	0.21%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	78,857,096	0.17%
LD	BONDES	240627	AAA(mex)	55,895,931	0.12%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	51,719,527	0.11%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	44,165,355	0.09%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	13,260,367	0.03%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>5,689,352,563</b>	<b>12.11%</b>
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	2,502,567,325	5.33%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,611,790,800	3.43%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	703,286,759	1.50%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	501,328,455	1.07%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	370,379,224	0.79%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>46,966,674,987</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>47,693,225,641</b>	

**Cartera al: 30/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.047 %**  
**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."**