



**MEDIANO PLAZO**

**HR Ratings de México, S.A. De C.V.**

**AA/1CP**

<b>T.VALOR</b>	<b>EMISORA</b>	<b>SERIE</b>	<b>CALIF/BURS</b>	<b>VALOR TOTAL</b>	<b>%</b>
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>96,228,538</b>	<b>1.37%</b>
CD	NAFF	250307	AAA (mex)	96,228,538	1.37%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>315,645,142</b>	<b>4.48%</b>
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,423,766	2.86%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	63,885,948	0.91%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,335,428	0.72%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>3,165,706,700</b>	<b>44.95%</b>
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	250,553,293	3.56%
91	TPLAYCB	20	HR AA	242,940,013	3.45%
91	AERMxcb	19	HR AA+	183,918,501	2.61%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	164,637,903	2.34%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	132,162,174	1.88%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	130,307,410	1.85%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,533,408	1.77%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,277,578	1.69%
91	NM	24	mxAA+	100,603,872	1.43%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,551,510	1.43%
91	DONDE	23	HR AA	100,381,347	1.43%
91	SALUD	21	HR A+	100,231,052	1.42%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	94,129,800	1.34%
91	GAP	21	mxAAA	91,708,318	1.30%
91	ARA	23X	mxAA-	90,760,014	1.29%
91	LALA	19-2	AA (mex)	87,530,336	1.24%
91	GICSA	19	B/M	84,841,457	1.21%
91	SALUD	20	HR A+	80,744,459	1.15%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,563,402	1.07%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,528,069	1.07%
91	TPLAY	22	HR A	75,170,116	1.07%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,261,438	0.91%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,401,815	0.86%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	59,562,069	0.85%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,778,436	0.84%

91	GHEMA	23	HR A-	50,476,899	0.72%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	50,018,768	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	42,260,137	0.60%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,673,380	0.58%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,152,247	0.57%
91	LAB	23	AA (mex)	35,115,177	0.50%
91	GICSA	17	B/M	32,929,624	0.47%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,262,579	0.43%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,152,667	0.36%
91	CYDSASA	23	HR AA+	21,052,868	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,007,624	0.28%
91	GAP	20	mxAAA	11,268,204	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	10,027,370	0.14%
91	CADU	19	HR BBB	7,231,367	0.10%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>1,265,622,663</b>	<b>17.97%</b>
BI	CETES	240905	AAA(mex)	717,413,475	10.19%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	523,574,438	7.44%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	21,514,493	0.31%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,120,257	0.04%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>28,230,478</b>	<b>0.40%</b>
CHD	40-133	8034399		28,230,478	0.40%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>				<b>100,795,049</b>	<b>1.43%</b>
D2	GS227	240515	BBB+	100,795,049	1.43%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>424,486,541</b>	<b>6.03%</b>
93	TPLAY	00123	HR2	201,144,202	2.86%
93	ELEKTRA	00124	HR1	120,123,948	1.71%
93	DONDE	00124	HR1	50,378,276	0.72%
93	ALMER	00223	F1 (mex)	15,083,078	0.21%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,054,046	0.21%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,879,369	0.20%
93	HYCSA	00123	HR2	8,823,622	0.13%
<b>Swaps Entregables</b>				<b>-26,766,550</b>	<b>-0.38%</b>
SWP	2TIEMXP	240419		-962,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240422		-824,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250207		-918,750	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-1,014,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-4,244,000	-0.06%
SWP	2TIEMXP	250815		-3,644,000	-0.05%
SWP	2TIEMXP	241111		-202,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-7,018,500	-0.10%
SWP	2TIEMXP	260317		-8,404,000	-0.12%

SWP	2TIEMXP	240926		465,200	0.01%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>422,610,418</b>	<b>6.00%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	206,083,646	2.93%
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	125,975,197	1.79%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,551,575	1.29%
	<b>Reportos</b>			<b>1,249,864,827</b>	<b>17.75%</b>
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,249,864,827	17.75%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,042,423,806</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,065,524,224</b>	

**Cartera al: 11/04/2024**

**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."**