

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			8,600,913,446	18.01%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	3,285,112,110	6.88%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	2,304,417,220	4.82%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,991,221,097	4.17%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	696,628,050	1.46%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	134,264,604	0.28%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	96,293,754	0.20%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	92,976,611	0.20%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,480,701,764	3.10%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	838,648,096	1.76%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	566,862,543	1.19%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,191,126	0.16%
	Certificados de Depósito			1,145,864,658	2.40%
F	BMULTIV	23048	mxA-2	504,095,630	1.06%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	350,345,177	0.73%
F	BMULTIV	23031	mxA-2	291,423,851	0.61%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,110,019,607	4.42%
94	BACTIN	22	AA (mex)	451,784,169	0.95%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	405,464,048	0.85%
94	BACTIN	23	AA (mex)	402,420,704	0.84%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	362,011,964	0.76%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,991,203	0.54%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,347,518	0.49%
	Certificados Bursátiles Corporativos			4,628,209,379	9.69%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	652,398,005	1.37%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	418,938,581	0.88%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	400,675,648	0.84%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,906,632	0.77%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,844,446	0.74%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	251,239,563	0.53%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	248,104,955	0.52%
91	NM	24	mxAA+	204,115,235	0.43%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,425,450	0.38%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,090,313	0.33%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	157,855,984	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,423,479	0.32%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	142,041,754	0.30%
91	FINN	18	A- (mex)	126,365,733	0.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,408,328	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,315,062	0.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,042,764	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	85,403,299	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	81,038,773	0.17%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,447,493	0.13%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	58,073,923	0.12%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,402,337	0.12%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,291,665	0.11%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	44,525,057	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,450,594	0.09%
91	AERMxcb	19	HR AA+	32,184,491	0.07%
91	GAP	21V	mxAAA	15,033,517	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,166,300	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

16,922,128,860

35.43%

BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,768,901,648	3.70%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,707,067,766	3.57%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,631,502,598	3.42%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	1,450,366,752	3.04%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,400,469,871	2.93%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,356,817,950	2.84%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,257,016,148	2.63%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	960,478,266	2.01%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	873,754,830	1.83%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	851,702,698	1.78%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	738,522,320	1.55%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	673,108,725	1.41%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	591,611,175	1.24%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	447,131,664	0.94%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	443,057,516	0.93%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	323,445,192	0.68%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	187,728,100	0.39%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	131,340,027	0.28%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	113,651,579	0.24%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	14,454,034	0.03%

Chequera Euros

51,480

0.00%

CHE	40-012	5500702		51,480	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

	Chequera Dolares			93,917,258	0.20%
CHD	40-133	8035859		93,917,258	0.20%
	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			600,072,902	1.26%
D8	CAF0627	90	AA-	399,147,780	0.84%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,925,122	0.42%
	Titulos de Credito Extranjeros			650,122,637	1.36%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	348,119,044	0.73%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	168,323,255	0.35%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	133,680,337	0.28%
	Eurobonos de Empresas Privadas			650,795,186	1.36%
D2	GS227	240515	BBB+	301,608,990	0.63%
D2	CAF872	310222	AA-	249,959,465	0.52%
D2	KEXIM	250426	AA	99,226,731	0.21%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			130,960,077	0.27%
93	TPLAY	00223	HR2	100,802,224	0.21%
93	MINSA	00124	HR2	15,108,087	0.03%
93	TPLAY	00124	HR2	15,049,766	0.03%
	Swaps Entregables			-12,710,710	-0.03%
SWP	2TIEMXP	240724		-5,132,810	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241025		-6,078,900	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-359,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,140,000	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			531,516,357	1.11%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	430,758,051	0.90%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,758,306	0.21%
	Udibonos			1,272,321,339	2.66%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	842,198,503	1.76%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	430,122,836	0.90%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,643,973,648	3.44%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	421,594,841	0.88%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	418,171,360	0.88%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	351,569,449	0.74%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,950,315	0.53%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,500,245	0.25%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,187,438	0.17%
	Reportos			1,640,160,807	3.43%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	398,857,693	0.84%

LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	300,092,151	0.63%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	297,265,056	0.62%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	292,150,360	0.61%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	251,764,988	0.53%
LD	BONDES	240627	AAA(mex)	55,435,691	0.12%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	44,594,869	0.09%

Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal

5,677,385,487

11.89%

LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	2,503,355,750	5.24%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,598,536,416	3.35%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	703,508,295	1.47%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	501,487,450	1.05%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	370,497,576	0.78%

TOTAL CARTERA

47,766,404,182

100.00%

ACTIVO NETO

47,673,537,678

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.052 %
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."