

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij</b>			<b>99,626,971</b>	<b>1.39%</b>
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	99,626,971	1.39%
	<b>Certificados Bursatiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>96,987,499</b>	<b>1.36%</b>
CD	NAFF	250307	AAA (mex)	96,987,499	1.36%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>316,148,740</b>	<b>4.42%</b>
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,662,278	2.82%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	64,156,470	0.90%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,329,992	0.70%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>3,079,631,344</b>	<b>43.05%</b>
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	250,470,567	3.50%
91	TPLAYCB	20	HR AA	224,795,248	3.14%
91	AERMxCB	19	HR AA+	175,117,449	2.45%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	164,612,247	2.30%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	132,024,070	1.85%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	130,307,172	1.82%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,372,083	1.74%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,277,496	1.67%
91	NM	24	mxAA+	100,586,324	1.41%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,551,821	1.41%
91	DONDE	23	HR AA	100,381,432	1.40%
91	SALUD	21	HR A+	100,231,598	1.40%
91	GAP	21	mxAAA	91,571,977	1.28%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	90,896,605	1.27%
91	ARA	23X	mxAA-	90,743,371	1.27%
91	LALA	19-2	AA (mex)	87,490,063	1.22%
91	GICSA	19	B/M	86,371,550	1.21%
91	SALUD	20	HR A+	80,720,339	1.13%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,549,743	1.06%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,514,914	1.06%
91	TPLAY	22	HR A	75,184,653	1.05%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,257,663	0.90%

91	VOLARCB	23	HR AA+	60,277,552	0.84%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	59,560,829	0.83%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,813,153	0.82%
91	GHEMA	23	HR A-	50,468,025	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	42,694,033	0.60%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,644,471	0.57%
91	BEGRAND	23	HR A+	40,152,449	0.56%
91	LAB	23	AA (mex)	35,115,357	0.49%
91	GICSA	17	B/M	33,550,629	0.47%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,257,042	0.42%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,147,541	0.35%
91	CYDSASA	23	HR AA+	21,049,179	0.29%
91	HYCSA	24	HR AA	20,007,622	0.28%
91	GAP	20	mxAAA	11,257,669	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	9,607,408	0.13%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>1,624,966,970</b>	<b>22.71%</b>
BI	CETES	240905	AAA(mex)	723,556,350	10.11%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	527,727,125	7.38%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	348,835,483	4.88%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	24,848,013	0.35%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>12,073,457</b>	<b>0.17%</b>
CHD	40-133	8034399		12,073,457	0.17%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>				<b>100,767,476</b>	<b>1.41%</b>
D2	GS227	240515	BBB+	100,767,476	1.41%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>321,248,602</b>	<b>4.49%</b>
93	ELEKTRA	00124	HR1	120,123,866	1.68%
93	TPLAY	00124	HR2	100,589,079	1.41%
93	DONDE	00124	HR1	50,369,046	0.70%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,073,834	0.21%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,879,367	0.19%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	12,389,789	0.17%
93	HYCSA	00123	HR2	8,823,619	0.12%
<b>Swaps Entregables</b>				<b>-21,210,750</b>	<b>-0.30%</b>
SWP	2TIEMXP	250207		-509,250	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-623,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-3,690,500	-0.05%
SWP	2TIEMXP	250815		-3,165,500	-0.04%
SWP	2TIEMXP	241111		-87,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-6,214,500	-0.09%
SWP	2TIEMXP	260317		-7,361,000	-0.10%
SWP	2TIEMXP	240926		440,000	0.01%

	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>422,523,238</b>	<b>5.91%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	205,951,503	2.88%
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	125,964,658	1.76%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,607,077	1.27%
	<b>Reportos</b>			<b>1,101,295,930</b>	<b>15.39%</b>
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	1,101,295,930	15.39%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,154,059,477</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,074,040,128</b>	

**Cartera al: 09/05/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.300 % Var Promedio: 0.075 %**  
**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."**