

MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			755,734,305	1.55%
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	755,734,305	1.55%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			4,766,572,046	9.79%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,359,053,269	2.79%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	1,354,840,489	2.78%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	1,171,047,222	2.41%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	650,555,360	1.34%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	135,589,218	0.28%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	95,486,489	0.20%
	Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Mensual De Inte			653,603,204	1.34%
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	653,603,204	1.34%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,479,859,254	3.04%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	837,828,003	1.72%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	566,260,045	1.16%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,771,206	0.16%
	Certificados de Depósito			1,147,781,227	2.36%
F	BMULTIV	23048	mxA-2	503,527,120	1.04%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	353,159,601	0.73%
F	BMULTIV	23031	mxA-2	291,094,506	0.60%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,111,445,897	4.34%
94	BACTIN	22	AA (mex)	451,253,367	0.93%
94	BACTIN	23	AA (mex)	405,715,708	0.83%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	405,050,260	0.83%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,601,024	0.74%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,706,251	0.53%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,119,287	0.48%
	Certificados Bursátiles Corporativos			4,659,598,758	9.57%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	658,037,196	1.35%

91	LAB	23-2	AA+ (mex)	422,393,995	0.87%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	404,015,692	0.83%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,516,476	0.75%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	353,649,203	0.73%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	250,946,180	0.52%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	248,061,139	0.51%
91	NM	24	mxAA+	203,885,719	0.42%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,283,928	0.38%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	162,348,763	0.33%
91	LALA	19-2	AA (mex)	160,436,940	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,247,312	0.31%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	143,777,149	0.30%
91	FINN	18	A- (mex)	131,703,872	0.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,466,371	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	97,190,792	0.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	86,945,838	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	86,095,143	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	81,005,311	0.17%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,378,857	0.12%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	57,989,843	0.12%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,353,587	0.11%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,222,771	0.10%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	46,041,829	0.10%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,540,128	0.08%
91	AERMxCB	19	HR AA+	33,754,527	0.07%
91	GAP	21V	mxAAA	15,151,698	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,158,499	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

18,181,665,665

37.36%

BI	CETES	240516	AAA(mex)	1,775,515,860	3.65%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,754,845,412	3.61%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,695,393,331	3.48%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	1,477,684,339	3.04%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	1,436,541,924	2.95%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,400,691,249	2.88%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,245,687,216	2.56%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,112,515,866	2.29%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	945,515,217	1.94%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	865,401,930	1.78%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	848,858,825	1.74%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	733,174,720	1.51%
BI	CETES	240411	AAA(mex)	588,131,987	1.21%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	587,717,805	1.21%
BI	CETES	240418	AAA(mex)	497,401,800	1.02%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	447,288,642	0.92%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	320,401,973	0.66%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	186,164,020	0.38%

BI	CETES	240613	AAA(mex)	130,064,557	0.27%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	112,543,909	0.23%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	20,125,083	0.04%
	Chequera Euros			50,588	0.00%
CHE	40-012	5500702		50,588	0.00%
	Chequera Dolares			308,499,983	0.63%
CHD	40-133	8035859		308,499,983	0.63%
	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			603,351,107	1.24%
D8	CAF0627	90	AA-	402,681,029	0.83%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,670,077	0.41%
	Títulos de Credito Extranjeros			504,993,768	1.04%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	200,238,374	0.41%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	169,819,350	0.35%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	134,936,044	0.28%
	Eurobonos de Empresas Privadas			658,876,883	1.35%
D2	GS227	240515	BBB+	301,295,171	0.62%
D2	CAF872	310222	AA-	254,215,581	0.52%
D2	KEXIM	250426	AA	103,366,130	0.21%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			135,809,585	0.28%
93	TPLAY	00223	HR2	100,679,566	0.21%
93	ALMER	00223	F1 (mex)	20,039,097	0.04%
93	MINSA	00124	HR2	15,090,922	0.03%
	Swaps Entregables			-15,132,860	-0.03%
SWP	2TIEMXP	240724		-8,593,560	-0.02%
SWP	2TIEMXP	241025		-6,258,300	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-387,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		106,500	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			534,536,987	1.10%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	433,889,230	0.89%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,647,757	0.21%
	Udibonos			995,478,375	2.05%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	849,683,785	1.75%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	145,794,590	0.30%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,643,136,724	3.38%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	424,813,830	0.87%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	413,687,392	0.85%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	351,181,712	0.72%

95	PEMEX	19	mxAAA	252,855,473	0.52%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	121,504,513	0.25%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,093,804	0.16%
	Reportos			1,254,072,191	2.58%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,053,764,823	2.17%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	100,153,831	0.21%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	100,153,536	0.21%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			8,287,031,006	17.03%
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	2,500,835,900	5.14%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,610,350,096	3.31%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	1,500,952,365	3.08%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	702,512,412	1.44%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	600,329,076	1.23%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	501,443,550	1.03%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	500,723,065	1.03%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	369,884,542	0.76%
	TOTAL CARTERA			48,666,964,693	100.00%
	ACTIVO NETO			48,678,692,918	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.034 %
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."