

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>186,227,039</b>	<b>5.50%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,742,095	1.85%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,233,914	1.75%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,807,289	1.03%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,443,742	0.87%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>1,865,739,239</b>	<b>55.14%</b>
91	LALA	19-2	AA (mex)	151,471,553	4.48%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,508,564	3.65%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,923,110	3.54%
91	DONDE	23	HR AA	100,891,533	2.98%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,764,116	2.98%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,711,016	2.98%
91	ARA	23X	mxAA-	100,469,779	2.97%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,291,738	2.96%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,039,578	2.96%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,884,093	2.69%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	90,746,048	2.68%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,593,423	2.38%
91	TPLAYCB	20	HR AA	77,155,758	2.28%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,193,336	2.22%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,114,370	2.22%
91	TPLAY	22	HR A	74,803,266	2.21%
91	SALUD	20	HR A+	74,531,654	2.20%
91	SALUD	21	HR A+	50,273,651	1.49%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,366,094	1.19%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,124,434	1.19%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,109,946	1.19%
91	HYCSA	24	HR AA	20,114,751	0.59%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,047,496	0.59%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,609,934	0.52%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>624,232,603</b>	<b>18.45%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	276,036,573	8.16%

BI	CETES	250529	AAA(mex)	225,753,875	6.67%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	102,984,538	3.04%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,531,863	0.55%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	925,755	0.03%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>171,215</b>	<b>0.01%</b>
CHD	40-133	8355257		171,215	0.01%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>109,455,684</b>	<b>3.24%</b>
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,586,956	2.97%
93	HYCSA	00123	HR2	8,868,728	0.26%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-4,534,500</b>	<b>-0.13%</b>
SWP	2TIEMXP	250207		-950,500	-0.03%
SWP	2TIEMXP	240705		-151,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	240802		-184,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-203,700	-0.01%
SWP	2TIEMXP	260218		-3,321,500	-0.10%
SWP	2TIEMXP	240926		274,400	0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		1,800	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>124,438,284</b>	<b>3.68%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,438,284	3.68%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>191,886,455</b>	<b>5.67%</b>
95	PEMEX	13-2	mxAAA	100,930,065	2.98%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,956,390	2.69%
	<b>Reportos</b>			<b>286,226,546</b>	<b>8.46%</b>
LD	BONDES	241219	AAA(mex)	286,226,546	8.46%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,383,842,565</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,397,290,898</b>	

**Cartera al: 20/06/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.033 %**  
**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."**