

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			13,687,210,175	28.75%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	7,909,189,001	16.62%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	2,553,822,005	5.37%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,922,233,332	4.04%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	900,096,787	1.89%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	266,597,544	0.56%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	135,271,506	0.28%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			99,935,834	0.21%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	99,935,834	0.21%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,477,925,383	3.11%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	836,651,126	1.76%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	565,594,085	1.19%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,680,172	0.16%
	Certificados de Depósito			855,694,884	1.80%
F	BMULTIV	23048	mxA-2	502,945,875	1.06%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	352,749,009	0.74%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,104,958,080	4.42%
94	BACTIN	22	AA (mex)	450,750,573	0.95%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	404,448,640	0.85%
94	BACTIN	23	AA (mex)	401,414,336	0.84%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,182,402	0.76%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,414,435	0.54%
94	BACTIN	21	AA (mex)	231,747,694	0.49%
	Certificados Bursátiles Corporativos			5,539,507,423	11.64%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	657,341,050	1.38%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	422,106,123	0.89%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	403,056,464	0.85%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	402,967,116	0.85%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,101,996	0.77%

91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,039,269	0.74%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	301,523,688	0.63%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	250,644,453	0.53%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	248,212,910	0.52%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	247,017,127	0.52%
91	NM	24	mxAA+	203,723,952	0.43%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	181,552,604	0.38%
91	LALA	19-2	AA (mex)	160,273,766	0.34%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	156,414,348	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,066,524	0.32%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	134,449,728	0.28%
91	FINN	18	A- (mex)	126,626,466	0.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,039,578	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,043,998	0.20%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	88,111,428	0.19%
91	DAIMLER	23	mxAAA	86,844,596	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	85,993,983	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,663,154	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	53,227,133	0.11%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,155,542	0.11%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	41,396,719	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	40,813,381	0.09%
91	AERMXCB	19	HR AA+	28,829,347	0.06%
91	GAP	21V	mxAAA	15,134,050	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,136,931	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

13,653,431,590

28.68%

BI	CETES	260416	AAA(mex)	1,956,225,893	4.11%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,794,898,530	3.77%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,732,316,170	3.64%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	1,612,152,462	3.39%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,415,855,281	2.97%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,376,565,450	2.89%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	873,392,004	1.84%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	863,758,180	1.82%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	749,374,240	1.57%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	600,202,135	1.26%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	451,539,684	0.95%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	190,508,440	0.40%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	21,706,682	0.05%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,655,369	0.02%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	5,017,132	0.01%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	263,937	0.00%

Chequera Euros

55,538

0.00%

CHE	40-012	5500702		55,538	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

	Chequera Dolares			532,651	0.00%
CHD	40-133	8035859		532,651	0.00%
	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			584,280,319	1.23%
D8	CAF0627	90	AA-	383,850,006	0.81%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,430,313	0.42%
	Forward de Divisas			-320,949	0.00%
FWD	MXPUSD	240628		-320,949	0.00%
	Títulos de Credito Extranjeros			650,450,939	1.37%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	349,441,549	0.73%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	167,632,931	0.35%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	133,376,459	0.28%
	Eurobonos de Empresas Privadas			350,476,919	0.74%
D2	CAF872	310222	AA-	249,736,705	0.53%
D2	KEXIM	250426	AA	100,740,214	0.21%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			130,642,850	0.27%
93	TPLAY	00223	HR2	100,557,494	0.21%
93	MINSA	00124	HR2	15,077,812	0.03%
93	TPLAY	00124	HR2	15,007,544	0.03%
	Swaps Entregables			-9,676,880	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240724		-3,511,980	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241025		-4,555,150	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-184,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,425,750	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			534,338,838	1.12%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	433,658,823	0.91%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,680,015	0.21%
	Udibonos			1,452,986,588	3.05%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	832,304,590	1.75%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	395,661,583	0.83%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	225,020,415	0.47%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			2,016,787,139	4.24%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	790,180,470	1.66%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	424,463,155	0.89%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	350,783,972	0.74%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,152,435	0.53%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,194,200	0.25%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,012,908	0.17%

	Reportos			1,039,917,592	2.19%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	419,512,202	0.88%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	200,061,040	0.42%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	108,280,737	0.23%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	102,663,103	0.22%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	100,030,444	0.21%
LD	BONDESF	241219	AAA(mex)	65,595,058	0.14%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	43,775,007	0.09%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			3,431,331,766	7.21%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,609,123,280	3.38%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	702,192,225	1.48%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	500,524,515	1.05%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	369,618,896	0.78%
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	249,872,850	0.53%
	TOTAL CARTERA			47,600,466,679	100.00%
	ACTIVO NETO			47,517,339,393	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.068 %
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."