

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Trimestral De Ir</b>			<b>50,335,237</b>	<b>1.78%</b>
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,335,237	1.78%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>642,962,842</b>	<b>22.74%</b>
BI	CETES	251030	AAA(mex)	172,543,020	6.10%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	164,775,260	5.83%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	141,108,375	4.99%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	47,627,110	1.68%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,260,350	1.64%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	46,136,630	1.63%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,512,097	0.87%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>117,237</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8031130		117,237	0.00%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>170,581,619</b>	<b>6.03%</b>
93	START	00224	HR+1	27,187,570	0.96%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,876,587	0.70%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	19,194,096	0.68%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,069,381	0.67%
93	START	00724	HR+1	18,126,432	0.64%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,486,101	0.55%
93	START	00324	HR+1	12,251,206	0.43%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,025,723	0.36%
93	START	01724	HR+1	10,003,100	0.35%
93	GMFIN	05324	F1+ (mex)	9,765,212	0.35%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,596,211	0.34%
	<b>Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)</b>			<b>185,066,786</b>	<b>6.55%</b>
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	81,098,819	2.87%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	52,263,949	1.85%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	51,704,018	1.83%
	<b>Reportos</b>			<b>881,279,844</b>	<b>31.17%</b>

BI	CETES	241003	AAA(mex)	483,170,204	17.09%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	256,895,681	9.09%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	141,213,959	4.99%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>897,102,143</b>	<b>31.73%</b>
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	498,210,085	17.62%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	100,154,077	3.54%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,820,301	3.53%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,571,440	3.52%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,346,240	3.51%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>2,827,445,708</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>2,812,945,908</b>	

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

**Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.018 %**  
**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."**