

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				186,246,115	5.53%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,360,098	1.85%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,428,242	1.76%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,919,466	1.04%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,538,309	0.88%
Certificados Bursátiles Corporativos				1,914,261,432	56.80%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,582,948	4.47%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,963,578	3.68%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,386,038	3.57%
91	ARA	23X	mxAA-	100,827,965	2.99%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,610,515	2.99%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,410,404	2.98%
91	DONDE	23	HR AA	100,234,697	2.97%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,190,990	2.97%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,100,938	2.97%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	91,077,211	2.70%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,339,928	2.68%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,107,813	2.38%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,447,084	2.24%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,400,195	2.24%
91	TPLAY	22	HR A	75,096,163	2.23%
91	SALUD	20	HR A+	74,005,258	2.20%
91	TPLAYCB	20	HR AA	69,322,457	2.06%
91	SALUD	21	HR A+	50,463,837	1.50%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,280,434	1.20%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,239,873	1.19%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,091,412	1.19%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	37,080,855	1.10%
91	HYCSA	24	HR AA	20,191,566	0.60%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,115,481	0.60%
91	GASA	24	HR AA+	20,021,858	0.59%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,671,935	0.52%

	Certificados De La Tesorería De La Federación			627,188,671	18.61%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	277,501,120	8.23%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	226,585,975	6.72%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	103,585,150	3.07%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,587,873	0.55%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	928,553	0.03%
	Chequera Dolares			170,433	0.01%
CHD	40-133	8355257		170,433	0.01%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,834,551	3.26%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,933,604	3.00%
93	HYCSA	00123	HR2	8,900,947	0.26%
	Swaps Entregables			-3,380,750	-0.10%
SWP	2TIEMXP	250207		-542,500	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240705		-151,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	240802		-189,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		-11,700	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-133,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-2,612,750	-0.08%
SWP	2TIEMXP	240926		259,200	0.01%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,832,426	3.70%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,832,426	3.70%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			191,876,261	5.69%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	101,265,742	3.01%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,610,519	2.69%
	Reportos			219,202,133	6.50%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	219,202,133	6.50%
	TOTAL CARTERA			3,370,231,272	100.00%
	ACTIVO NETO			3,383,403,085	
	Cartera al:	28/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.032 %
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."