

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij</b>			<b>100,803,801</b>	<b>1.42%</b>
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	100,803,801	1.42%
	<b>Certificados Bursatiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>98,536,305</b>	<b>1.39%</b>
CD	NAFF	250307	AAA (mex)	98,536,305	1.39%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>315,659,658</b>	<b>4.45%</b>
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,351,798	2.84%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	64,054,784	0.90%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,253,076	0.71%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>3,188,520,463</b>	<b>44.96%</b>
91	TPLAYCB	20	HR AA	185,784,183	2.62%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	164,410,158	2.32%
91	AERMXCB	19	HR AA+	157,027,403	2.21%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	131,555,971	1.86%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	130,131,219	1.84%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	129,768,124	1.83%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,963,578	1.75%
91	EDUCA	23L	HR AAA	121,889,970	1.72%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,386,038	1.70%
91	NM	24	mxAA+	100,490,982	1.42%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,421,630	1.42%
91	DONDE	23	HR AA	100,234,697	1.41%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,190,990	1.41%
91	SALUD	21	HR A+	100,117,325	1.41%
91	GAP	21	mxAAA	91,402,709	1.29%
91	ARA	23X	mxAA-	90,745,169	1.28%
91	GICSA	19	B/M	88,213,143	1.24%
91	LALA	19-2	AA (mex)	87,428,460	1.23%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	84,602,404	1.19%
91	SALUD	20	HR A+	80,549,941	1.14%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,447,084	1.06%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,400,195	1.06%

91	TPLAY	22	HR A	75,096,163	1.06%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,086,250	0.90%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,122,938	0.85%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	60,064,383	0.85%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,730,188	0.83%
91	GHEMA	23	HR A-	50,389,733	0.71%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	43,473,791	0.61%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,495,141	0.57%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,091,412	0.57%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	38,988,013	0.55%
91	LAB	23	AA (mex)	35,069,245	0.49%
91	GICSA	17	B/M	34,187,710	0.48%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,210,325	0.43%
91	GASA	24	HR AA+	30,032,788	0.42%
91	TOYOTA	21	AAA (mex)	25,114,864	0.35%
91	CYDSASA	23	HR AA+	21,020,677	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,191,566	0.29%
91	GAP	20	mxAAA	11,243,575	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	9,750,326	0.14%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%

**Certificados De La Tesorería De La Federación**

**2,278,890,895**

**32.13%**

BI	CETES	240905	AAA(mex)	735,010,575	10.36%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	533,656,000	7.52%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	428,463,891	6.04%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	353,873,099	4.99%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	227,887,330	3.21%

**Chequera Dolares**

**13,173,560**

**0.19%**

CHD	40-133	8034399		13,173,560	0.19%
-----	--------	---------	--	------------	-------

**Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial**

**322,153,194**

**4.54%**

93	ELEKTRA	00124	HR1	121,120,325	1.71%
93	TPLAY	00124	HR2	100,418,091	1.42%
93	DONDE	00124	HR1	50,301,683	0.71%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,053,993	0.21%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,984,702	0.20%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	12,373,453	0.17%
93	HYCSA	00123	HR2	8,900,947	0.13%

**Swaps Entregables**

**-23,235,800**

**-0.33%**

SWP	2TIEMXP	250207		-813,750	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-378,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250812		-3,974,000	-0.06%
SWP	2TIEMXP	250815		-3,515,000	-0.05%
SWP	2TIEMXP	241111		-190,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-7,838,250	-0.11%

SWP	2TIEMXP	260317		-9,811,000	-0.14%
SWP	2TIEMXP	260610		3,025,000	0.04%
SWP	2TIEMXP	240926		259,200	0.00%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>298,046,894</b>	<b>4.20%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	207,436,376	2.93%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,610,519	1.28%
	<b>Reportos</b>			<b>500,122,535</b>	<b>7.05%</b>
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	500,122,535	7.05%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,092,671,505</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,116,247,246</b>	

**Cartera al: 28/06/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.300 % Var Promedio: 0.094 %**  
**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."**