

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados Bursátiles Bancarios			186,064,014	5.49%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,298,208	1.84%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,369,962	1.75%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,885,858	1.03%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,509,987	0.87%
	Certificados Bursátiles Corporativos			1,902,099,051	56.08%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,440,157	4.44%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,827,118	3.65%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,247,037	3.55%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,948,981	2.98%
91	ARA	23X	mxAA-	100,720,541	2.97%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,514,919	2.96%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,299,322	2.96%
91	DONDE	23	HR AA	100,125,888	2.95%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,095,967	2.95%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	90,978,016	2.68%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,250,345	2.66%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,027,429	2.36%
91	TPLAYCB	20	HR AA	77,356,962	2.28%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,371,008	2.22%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,314,499	2.22%
91	TPLAY	22	HR A	75,008,351	2.21%
91	SALUD	20	HR A+	74,728,341	2.20%
91	SALUD	21	HR A+	50,406,785	1.49%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,233,638	1.19%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,200,940	1.19%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,045,886	1.18%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	37,039,996	1.09%
91	HYCSA	24	HR AA	20,168,507	0.60%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,095,098	0.59%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,653,322	0.52%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			626,373,317	18.47%

BI	CETES	251224	AAA(mex)	277,169,880	8.17%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	226,308,525	6.67%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	103,395,288	3.05%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	18,571,871	0.55%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	927,753	0.03%
	Chequera Dolares			171,574	0.01%
CHD	40-133	8355257		171,574	0.01%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,720,821	3.24%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,829,539	2.97%
93	HYCSA	00123	HR2	8,891,282	0.26%
	Swaps Entregables			-3,644,150	-0.11%
SWP	2TIEMXP	250207		-759,500	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240705		-151,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	240802		-186,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		-6,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-143,850	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-2,665,000	-0.08%
SWP	2TIEMXP	240926		267,200	0.01%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,714,130	3.68%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,714,130	3.68%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			191,501,577	5.65%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	101,165,513	2.98%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,336,064	2.66%
	Reportos			254,786,935	7.51%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	254,786,935	7.51%
	TOTAL CARTERA			3,391,787,269	100.00%
	ACTIVO NETO			3,379,917,537	

Cartera al: 27/06/2024

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."