

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			13,503,113,382	28.56%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	7,927,098,716	16.77%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	2,473,864,823	5.23%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,926,732,462	4.08%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	904,869,389	1.91%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	135,958,565	0.29%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	134,589,428	0.29%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			100,436,327	0.21%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	100,436,327	0.21%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,480,517,688	3.13%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	838,483,258	1.77%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	566,846,344	1.20%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,188,087	0.16%
	Certificados de Depósito			854,440,807	1.81%
F	BMULTIV	23048	mxA-2	504,095,630	1.07%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	350,345,177	0.74%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,109,784,578	4.46%
94	BACTIN	22	AA (mex)	451,806,822	0.96%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	405,377,060	0.86%
94	BACTIN	23	AA (mex)	402,317,472	0.85%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	362,011,964	0.77%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,991,203	0.54%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,280,057	0.49%
	Certificados Bursátiles Corporativos			5,536,760,961	11.71%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	652,704,189	1.38%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	419,162,713	0.89%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	400,383,868	0.85%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	400,137,144	0.85%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,836,575	0.77%

91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,828,132	0.74%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	302,195,574	0.64%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	251,236,693	0.53%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	250,521,110	0.53%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	247,654,236	0.52%
91	NM	24	mxAA+	204,187,120	0.43%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,025,743	0.39%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,182,435	0.34%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	157,643,098	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,423,472	0.32%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	135,511,756	0.29%
91	FINN	18	A- (mex)	127,430,815	0.27%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,299,322	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,283,261	0.20%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	88,307,496	0.19%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,041,612	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	85,403,527	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,869,347	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	53,537,914	0.11%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,292,048	0.11%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	41,502,212	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	41,066,259	0.09%
91	AERMXCB	19	HR AA+	28,900,345	0.06%
91	GAP	21V	mxAAA	15,033,517	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,159,429	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

13,691,221,044

28.96%

BI	CETES	260416	AAA(mex)	1,964,028,227	4.15%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,799,051,101	3.81%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	1,736,460,610	3.67%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	1,615,249,608	3.42%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,421,668,277	3.01%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,379,520,150	2.92%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	875,537,823	1.85%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	865,698,557	1.83%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	751,118,880	1.59%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	601,694,715	1.27%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	453,533,580	0.96%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	190,936,340	0.40%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	21,753,425	0.05%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,676,908	0.02%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	5,028,324	0.01%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	264,519	0.00%

Chequera Euros

55,640

0.00%

CHE	40-012	5500702		55,640	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

	Chequera Dolares			18,942,722	0.04%
CHD	40-133	8035859		18,942,722	0.04%
	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			586,773,457	1.24%
D8	CAF0627	90	AA-	385,874,856	0.82%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,898,601	0.43%
	Forward de Divisas			184,425	0.00%
FWD	MXPUSD	240628		-346,035	0.00%
FWD	MXPUSD	240628		530,460	0.00%
	Títulos de Credito Extranjeros			655,427,317	1.39%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	352,118,644	0.75%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	168,744,087	0.36%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	134,564,586	0.29%
	Eurobonos de Empresas Privadas			353,144,104	0.75%
D2	CAF872	310222	AA-	252,111,845	0.53%
D2	KEXIM	250426	AA	101,032,260	0.21%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			130,960,240	0.28%
93	TPLAY	00223	HR2	100,801,921	0.21%
93	MINSA	00124	HR2	15,112,141	0.03%
93	TPLAY	00124	HR2	15,046,178	0.03%
	Swaps Entregables			-7,634,210	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240724		-1,753,810	0.00%
SWP	2TIEMXP	241025		-4,555,150	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-186,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		-1,139,250	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			100,903,196	0.21%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,903,196	0.21%
	Udibonos			1,469,737,227	3.11%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	842,802,467	1.78%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	397,814,325	0.84%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	229,120,435	0.49%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			2,017,543,773	4.27%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	792,023,790	1.68%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	421,568,297	0.89%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	351,569,477	0.74%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,725,398	0.54%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,469,832	0.26%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,186,980	0.17%

	Reportos			1,254,743,501	2.65%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	734,368,250	1.55%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	109,370,154	0.23%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	108,280,825	0.23%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	100,030,583	0.21%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	100,030,558	0.21%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	66,744,331	0.14%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	35,918,801	0.08%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			3,425,075,103	7.24%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,598,846,288	3.38%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	703,734,871	1.49%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	501,636,750	1.06%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	370,444,792	0.78%
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	250,412,403	0.53%
	TOTAL CARTERA			47,282,131,285	100.00%
	ACTIVO NETO			47,456,307,295	

Cartera al: 27/06/2024

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."