

## DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>1,170,538,202</b>	<b>15.44%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	660,551,411	8.72%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	266,597,544	3.52%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	180,362,008	2.38%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,027,239	0.83%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>601,079,134</b>	<b>7.93%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	601,079,134	7.93%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>70,026,238</b>	<b>0.92%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	70,026,238	0.92%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,880,598,102</b>	<b>38.00%</b>
91	AERMxCB	19	HR AA+	210,642,292	2.78%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	202,025,678	2.67%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	193,324,344	2.55%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,634,828	2.46%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	181,230,734	2.39%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,525,128	2.38%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	167,628,240	2.21%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	161,905,966	2.14%
91	GICSA	19	B/M	157,999,140	2.08%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,205,467	1.89%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	117,095,381	1.55%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,257,781	1.32%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	99,300,159	1.31%
91	TPLAYCB	20	HR AA	92,554,504	1.22%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	89,679,398	1.18%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	87,560,239	1.16%
91	CADU	20V	A/M	68,440,546	0.90%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	67,923,532	0.90%
91	LAMOSAS	19	AA (mex)	62,293,792	0.82%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,891,784	0.66%
91	GHEMA	23	HR A-	43,158,707	0.57%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,170,527	0.53%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	39,780,216	0.53%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	28,391,489	0.38%
91	GICSA	17	B/M	21,615,896	0.29%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	20,312,549	0.27%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,183,047	0.27%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,049,210	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,445,906	0.22%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,369,446	0.12%
91	GICSA	15	B/M	2,002,176	0.03%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>137,089,436</b>	<b>1.81%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	127,401,495	1.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,687,941	0.13%
	<b>Chequera Euros</b>			<b>83,322</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		83,322	0.00%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>4,093,233</b>	<b>0.05%</b>
CHD	40-133	8030298		4,093,233	0.05%
	<b>Forward de Divisas</b>			<b>-427,932</b>	<b>-0.01%</b>
FWD	MXPUSD	240628		-427,932	-0.01%
	<b>Títulos de Credito Extranjeros</b>			<b>186,371,495</b>	<b>2.46%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	186,371,495	2.46%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>416,227,841</b>	<b>5.49%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	416,227,841	5.49%
	<b>Opciones CALL Divisas</b>			<b>5,427,140</b>	<b>0.07%</b>
CALL	MXPUSD	240814		5,427,140	0.07%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>90,501,745</b>	<b>1.19%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,501,745	1.19%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-3,367,523</b>	<b>-0.04%</b>
SWP	2TIEMXP	290413		-1,127,200	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240802		-184,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-378,300	-0.01%
SWP	2TIEMXP	290419		-1,083,500	-0.01%
SWP	1USDSUS	290613		-1,554,773	-0.02%
SWP	2TIEMXP	290606		960,250	0.01%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>95,328,167</b>	<b>1.26%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,328,167	1.26%

	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,517,611,371</b>	<b>20.02%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	665,682,428	8.78%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	469,765,979	6.20%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	256,377,357	3.38%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	125,785,607	1.66%
	<b>Reportos</b>			<b>408,635,432</b>	<b>5.39%</b>
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	375,625,365	4.96%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	33,010,067	0.44%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,579,815,403</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,586,612,747</b>	

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

**Límite Máximo de VaR:** 0.492 % **Var Promedio:** 0.214 %  
**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."