

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			1,051,637,484	13.71%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	670,130,660	8.73%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	182,552,206	2.38%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	135,488,943	1.77%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,465,675	0.83%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			599,230,305	7.81%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	599,230,305	7.81%
	Certificados Bursátiles Bancarios			67,747,817	0.88%
94	COMPART	20	AA (mex)	67,747,817	0.88%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,590,060,351	33.76%
91	AERMXCB	19	HR AA+	198,855,111	2.59%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	196,503,252	2.56%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,628,559	2.43%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	183,933,394	2.40%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,528,919	2.35%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	170,498,854	2.22%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	164,279,773	2.14%
91	GICSA	19	B/M	161,558,271	2.11%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,076,203	1.87%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	117,700,956	1.53%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,257,207	1.31%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	99,869,949	1.30%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	88,815,682	1.16%
91	TPLAYCB	20	HR AA	83,716,566	1.09%
91	CADU	20V	A/M	69,692,870	0.91%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	68,782,018	0.90%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	63,294,925	0.83%
91	IDEI	23+V	HR BBB	48,494,802	0.63%
91	GHEMA	23	HR A-	43,158,709	0.56%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,951,604	0.53%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	40,186,712	0.52%

91	AXO	16-2	A+ (mex)	28,780,608	0.38%
91	GICSA	17	B/M	22,090,097	0.29%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	20,645,304	0.27%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,183,202	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,335,687	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,697,273	0.22%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,496,362	0.12%
91	GICSA	15	B/M	2,047,483	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			138,585,726	1.81%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	128,815,695	1.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,770,031	0.13%
	Chequera Euros			83,004	0.00%
CHE	40-012	5514622		83,004	0.00%
	Chequera Dolares			77,772,517	1.01%
CHD	40-110	8377998		72,001,186	0.94%
CHD	40-133	8030298		5,771,331	0.08%
	Titulos de Credito Extranjeros			187,986,211	2.45%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	187,986,211	2.45%
	Eurobonos de Empresas Privadas			423,163,904	5.52%
D2	CAF872	310222	AA-	423,163,904	5.52%
	Opciones CALL Divisas			1,973,130	0.03%
CALL	MXPUSD	240814		1,973,130	0.03%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			90,501,608	1.18%
93	TPLAY	00223	HR2	90,501,608	1.18%
	Swaps Entregables			-205,710	0.00%
SWP	2TIEMXP	240802		-95,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-270,400	0.00%
SWP	1USDSUS	290723		-510	0.00%
SWP	2TIEMXP	290713		160,200	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			95,324,178	1.24%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,324,178	1.24%
	Udibonos			201,746,189	2.63%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	201,746,189	2.63%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,531,245,867	19.96%
95	PEMEX	19	mxAAA	665,423,293	8.67%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	479,265,752	6.25%

95	PEMEX	14-2	mxAAA	259,642,133	3.38%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	126,914,690	1.65%
	Reportos			615,675,987	8.02%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	582,665,916	7.59%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,745,108	0.30%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	10,264,963	0.13%
	TOTAL CARTERA			7,672,528,568	100.00%
	ACTIVO NETO			7,714,967,626	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.202 %
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."