

DISCRECIONAL					
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			1,322,870,934	56.81%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	534,734,372	22.96%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	204,677,902	8.79%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	151,655,394	6.51%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	109,249,052	4.69%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	97,752,433	4.20%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	93,760,082	4.03%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	85,951,198	3.69%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	45,090,502	1.94%
	Certificados Bursátiles Corporativos			242,959,928	10.43%
91	LALA	18	AA (mex)	90,911,999	3.90%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,059,195	3.52%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	38,690,569	1.66%
91	BRX	22	AAA (mex)	20,143,294	0.87%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,154,871	0.48%
	Chequera Dolares			207	0.00%
CHD	40-133	8034712		207	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			39,709,267	1.71%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	39,709,267	1.71%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			20,111,499	0.86%
93	TPLAY	00223	HR2	20,111,499	0.86%
	Udibonos			15,597,562	0.67%
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	15,597,562	0.67%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			227,646,871	9.78%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	151,376,425	6.50%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	76,270,445	3.28%
	Reportos			459,728,873	19.74%

LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	459,728,873	19.74%
	TOTAL CARTERA			2,328,625,141	100.00%
	ACTIVO NETO			2,328,090,439	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.280 %
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."