

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

A/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			435,800,815	25.51%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	194,198,076	11.37%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	105,290,218	6.16%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	89,918,814	5.26%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,176,014	1.88%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,217,693	0.83%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			43,164,834	2.53%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	25,214,999	1.48%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,416,899	0.79%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,453,214	0.26%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	79,722	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			465,730,514	27.27%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	40,269,071	2.36%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,085,245	1.59%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,688,501	1.45%
91	OSM	15U	mxAA-	22,243,849	1.30%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,529,465	1.26%
91	GAP	23-2L	mxAAA	20,987,376	1.23%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,496,547	1.20%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,550,875	1.15%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,427,057	1.14%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,043,066	1.12%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,237,756	1.07%
91	SALUD	21	HR A+	17,953,201	1.05%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	17,744,307	1.04%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	17,740,382	1.04%
91	SALUD	20	HR A+	16,731,596	0.98%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,464,546	0.91%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,184,230	0.89%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,166,772	0.83%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,547,828	0.74%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,839,634	0.69%

91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,223,429	0.54%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,718,464	0.51%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,190,811	0.42%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,049,771	0.41%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,080,455	0.36%
91	GHEMA	23	HR A-	6,023,350	0.35%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,262,909	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,801,720	0.28%
91	NM	15	mxAA+	4,013,141	0.24%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,881,864	0.17%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	2,845,729	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,593,215	0.15%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,787,464	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,304,133	0.08%
91	GHOCB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	741,394	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	610,497	0.04%
91	DMXI	15	mxD	529,881	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,891	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			72,968,830	4.27%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,193,815	2.41%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	31,775,015	1.86%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			24,052,524	1.41%
IISP	SHV	*	Alta	24,052,524	1.41%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,006,557	0.82%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,006,557	0.82%
	Udibonos			486,679,550	28.49%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	228,971,645	13.41%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	159,941,257	9.36%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	75,971,711	4.45%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	21,794,937	1.28%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			52,685,533	3.09%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,529,799	0.68%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	7,682,571	0.45%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	6,866,497	0.40%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,782,819	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,350,041	0.37%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,447,884	0.32%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,912,291	0.23%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,332,696	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,780,935	0.10%

	Reportos			112,963,928	6.61%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	112,963,928	6.61%
	TOTAL CARTERA			1,708,053,085	100.00%
	ACTIVO NETO			1,711,802,937	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.539 %
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."