

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			924,583,101	12.12%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	679,045,747	8.90%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	183,553,122	2.41%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	61,984,233	0.81%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			602,325,796	7.89%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	602,325,796	7.89%
	Certificados Bursátiles Bancarios			68,929,422	0.90%
94	COMPART	20	AA (mex)	68,929,422	0.90%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,976,318,076	39.00%
91	AERMxCB	19	HR AA+	235,074,231	3.08%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,439,028	2.63%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	190,245,570	2.49%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,172,745	2.43%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	181,300,021	2.38%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,861,997	2.37%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	164,809,820	2.16%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	159,632,515	2.09%
91	GICSA	19	B/M	153,872,641	2.02%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,840,544	1.89%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	117,024,842	1.53%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,461,989	1.32%
91	TPLAYCB	20	HR AA	100,320,447	1.31%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	98,668,098	1.29%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	93,077,829	1.22%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	86,293,653	1.13%
91	CADU	20V	A/M	70,866,101	0.93%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	70,460,376	0.92%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	64,670,075	0.85%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,976,127	0.66%
91	GHEMA	23	HR A-	43,259,375	0.57%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	42,770,868	0.56%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	38,794,062	0.51%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	27,883,206	0.37%
91	VASCONI	22L	HR D	26,350,000	0.35%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	25,681,564	0.34%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,273,544	0.28%
91	GICSA	17	B/M	21,084,263	0.28%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,015,343	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,712,388	0.26%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,252,264	0.21%
91	VASCONI	19	HR D	14,504,438	0.19%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,715,431	0.13%
91	GICSA	15	B/M	1,952,682	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			135,347,997	1.77%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	125,807,070	1.65%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,540,927	0.13%
	Chequera Euros			77,569	0.00%
CHE	40-012	5514622		77,569	0.00%
	Chequera Dolares			113,759,810	1.49%
CHD	40-110	8377998		103,195,989	1.35%
CHD	40-133	8030298		10,563,821	0.14%
	Titulos de Credito Extranjeros			190,128,948	2.49%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	190,128,948	2.49%
	Eurobonos de Empresas Privadas			411,206,459	5.39%
D2	CAF872	310222	AA-	411,206,459	5.39%
	Opciones CALL Divisas			1,929,410	0.03%
CALL	MXPUSD	240814		1,929,410	0.03%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			90,690,564	1.19%
93	TPLAY	00223	HR2	90,690,564	1.19%
	Swaps Entregables			-2,898,550	-0.04%
SWP	2TIEMXP	290413		-1,140,600	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240802		-368,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-294,450	0.00%
SWP	2TIEMXP	290419		-1,095,000	-0.01%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			525,996,485	6.89%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	430,624,506	5.64%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,371,979	1.25%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,514,112,741	19.84%

95	PEMEX	19	mxAAA	667,572,913	8.75%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	459,590,724	6.02%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	263,195,712	3.45%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	123,753,392	1.62%
	Reportos			79,451,927	1.04%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	73,044,604	0.96%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	6,407,323	0.08%
	TOTAL CARTERA			7,631,959,754	100.00%
	ACTIVO NETO			7,631,846,947	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.166 %
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."