

## 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>1,118,270,479</b>	<b>14.67%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	688,274,959	9.03%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	186,828,240	2.45%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	180,463,414	2.37%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	62,703,867	0.82%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>603,013,687</b>	<b>7.91%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	603,013,687	7.91%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>69,708,141</b>	<b>0.91%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	69,708,141	0.91%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,908,938,195</b>	<b>38.16%</b>
91	AERMxCB	19	HR AA+	223,459,282	2.93%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,777,926	2.63%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	193,297,098	2.54%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	188,226,578	2.47%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,523,360	2.43%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	181,093,691	2.38%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	167,570,558	2.20%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	162,977,221	2.14%
91	GICSA	19	B/M	157,403,654	2.07%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,923,070	1.89%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	118,192,277	1.55%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,595,853	1.32%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	100,136,931	1.31%
91	TPLAYCB	20	HR AA	91,936,651	1.21%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	89,419,963	1.17%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	87,766,144	1.15%
91	CADU	20V	A/M	72,109,176	0.95%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	67,829,504	0.89%
91	LAMOSAS	19	AA (mex)	62,652,214	0.82%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,537,143	0.65%
91	GHEMA	23	HR A-	43,326,150	0.57%

91	VOLARCB	21L	HR AA+	41,400,553	0.54%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,673,966	0.53%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	28,301,853	0.37%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,671,101	0.28%
91	GICSA	17	B/M	21,630,618	0.28%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,045,528	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,058,736	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,550,346	0.22%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,854,086	0.13%
91	GICSA	15	B/M	1,996,966	0.03%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>136,835,659</b>	<b>1.80%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	127,201,110	1.67%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,634,549	0.13%
<b>Chequera Euros</b>				<b>78,054</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		78,054	0.00%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>113,917,513</b>	<b>1.49%</b>
CHD	40-110	8377998		102,268,176	1.34%
CHD	40-133	8030298		11,649,337	0.15%
<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>				<b>192,182,211</b>	<b>2.52%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	192,182,211	2.52%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>				<b>418,831,221</b>	<b>5.49%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	418,831,221	5.49%
<b>Opciones CALL Divisas</b>				<b>876,550</b>	<b>0.01%</b>
CALL	MXUSD	240814		876,550	0.01%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>90,815,513</b>	<b>1.19%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,815,513	1.19%
<b>Swaps Entregables</b>				<b>1,676,850</b>	<b>0.02%</b>
SWP	2TIEMXP	240802		-250,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-78,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	290419		1,263,750	0.02%
SWP	2TIEMXP	290413		741,600	0.01%
<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>				<b>95,632,603</b>	<b>1.25%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,632,603	1.25%
<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>				<b>1,518,643,708</b>	<b>19.92%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	668,089,970	8.76%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	469,411,223	6.16%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	256,118,160	3.36%

95	PEMEX	13-2	mxAAA	125,024,355	1.64%
	<b>Reportos</b>			<b>354,628,031</b>	<b>4.65%</b>
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	321,597,514	4.22%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	33,030,518	0.43%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,624,048,415</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,625,008,549</b>	

**Cartera al:** 31/05/2024

**Límite Máximo de VaR:** 0.492 % **Var Promedio:** 0.197 %  
**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."