

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			1,045,556,094	13.73%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	665,635,970	8.74%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	181,688,070	2.39%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	134,975,729	1.77%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,256,326	0.83%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			602,959,093	7.92%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	602,959,093	7.92%
	Certificados Bursátiles Bancarios			67,483,452	0.89%
94	COMPART	20	AA (mex)	67,483,452	0.89%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,883,364,062	37.87%
91	AERMxCB	19	HR AA+	211,383,043	2.78%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,801,740	2.64%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	194,937,984	2.56%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,517,359	2.44%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	182,745,295	2.40%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	181,098,927	2.38%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	169,077,041	2.22%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	163,616,733	2.15%
91	GICSA	19	B/M	159,665,788	2.10%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,738,314	1.89%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	118,034,068	1.55%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,596,112	1.32%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	99,528,148	1.31%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	90,426,610	1.19%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	88,315,524	1.16%
91	TPLAYCB	20	HR AA	83,157,832	1.09%
91	CADU	20V	A/M	69,076,360	0.91%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	68,433,543	0.90%
91	LAMOSAS	19	AA (mex)	62,955,883	0.83%
91	IDEI	23+V	A/M	48,109,706	0.63%
91	GHEMA	23	HR A-	43,326,503	0.57%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,554,245	0.53%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	39,924,931	0.52%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	28,601,179	0.38%
91	GICSA	17	B/M	21,881,521	0.29%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	20,525,963	0.27%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,045,706	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,197,597	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,616,589	0.22%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,449,863	0.12%
91	GICSA	15	B/M	2,023,959	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			137,794,537	1.81%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	128,077,440	1.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,717,097	0.13%
	Chequera Euros			83,037	0.00%
CHE	40-012	5514622		83,037	0.00%
	Chequera Dolares			5,890,104	0.08%
CHD	40-133	8030298		5,890,104	0.08%
	Titulos de Credito Extranjeros			187,036,488	2.46%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	187,036,488	2.46%
	Eurobonos de Empresas Privadas			421,383,353	5.53%
D2	CAF872	310222	AA-	421,383,353	5.53%
	Opciones CALL Divisas			4,571,530	0.06%
CALL	MXPUSD	240814		4,571,530	0.06%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			90,816,085	1.19%
93	TPLAY	00223	HR2	90,816,085	1.19%
	Swaps Entregables			-650,299	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-189,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-247,000	0.00%
SWP	1USDSUS	290613		-878,999	-0.01%
SWP	2TIEMXP	290419		516,500	0.01%
SWP	2TIEMXP	290413		148,200	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			95,630,107	1.26%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,630,107	1.26%
	Udibonos			50,325,893	0.66%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	50,325,893	0.66%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,529,645,951	20.09%

95	PEMEX	19	mxAAA	667,843,942	8.77%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	476,841,816	6.26%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	258,756,244	3.40%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	126,203,950	1.66%
	Reportos			492,548,854	6.47%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	459,518,494	6.04%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	33,030,360	0.43%
	TOTAL CARTERA			7,614,438,341	100.00%
	ACTIVO NETO			7,631,955,890	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.213 %
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."