

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			459,550,550	27.26%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	206,971,092	12.28%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	111,231,468	6.60%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	94,753,002	5.62%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,377,678	1.92%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,217,311	0.84%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			44,725,939	2.65%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,005,702	1.54%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,061,938	0.83%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,579,033	0.27%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	79,265	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			471,742,371	27.98%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	40,610,909	2.41%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,729,640	1.65%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,838,845	1.47%
91	OSM	15U	mxAA-	22,471,907	1.33%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,580,093	1.28%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,110,994	1.25%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,640,948	1.22%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,534,804	1.22%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,465,704	1.16%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,217,807	1.14%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,591,191	1.10%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,400,638	1.09%
91	SALUD	21	HR A+	18,017,619	1.07%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	17,842,456	1.06%
91	SALUD	20	HR A+	16,618,579	0.99%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,265,486	0.97%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,192,869	0.90%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,260,507	0.85%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,570,625	0.75%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,907,976	0.71%

91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,196,746	0.55%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,687,714	0.52%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,182,255	0.43%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,007,110	0.42%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,297,947	0.37%
91	GHEMA	23	HR A-	6,046,719	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,270,483	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,797,373	0.29%
91	NM	15	mxAA+	3,993,254	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,770,324	0.22%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,873,014	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,644,700	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,784,989	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,309,520	0.08%
91	GHOCB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	739,080	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	617,885	0.04%
91	DMXI	15	mxD	512,689	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,880	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			72,899,013	4.32%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,158,020	2.44%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	31,740,993	1.88%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,836,060	0.88%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,836,060	0.88%
	Udibonos			545,137,832	32.33%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	244,059,844	14.48%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	166,878,938	9.90%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	78,837,143	4.68%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	32,906,673	1.95%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	22,455,234	1.33%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			53,283,602	3.16%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,829,408	0.70%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	7,883,001	0.47%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	6,883,204	0.41%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,789,198	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,369,350	0.38%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,479,083	0.33%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,951,983	0.23%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,318,578	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,779,797	0.11%
	Reportos			23,768,736	1.41%
LF	BONDESF	250313	AAA(mex)	23,768,736	1.41%

TOTAL CARTERA	1,685,944,103	100.00%
ACTIVO NETO	1,690,653,424	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.506 %
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."