

### DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

A/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>440,673,034</b>	<b>25.49%</b>
M	BONOS	421113	AAA(mex)	196,435,940	11.36%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	106,504,349	6.16%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	90,943,907	5.26%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,455,391	1.88%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,333,446	0.83%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>44,123,151</b>	<b>2.55%</b>
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	25,861,538	1.50%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,713,326	0.79%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,468,312	0.26%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	79,975	0.01%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>469,406,583</b>	<b>27.15%</b>
91	FIBRAHD	19U	HR AA	40,700,445	2.35%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,664,540	1.60%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,910,810	1.44%
91	OSM	15U	mxAA-	22,496,543	1.30%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,715,175	1.26%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,217,106	1.23%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,837,414	1.21%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,658,932	1.14%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,655,927	1.14%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,244,226	1.11%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,449,141	1.07%
91	SALUD	21	HR A+	18,021,119	1.04%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	17,928,936	1.04%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	17,886,917	1.03%
91	SALUD	20	HR A+	16,613,425	0.96%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,611,033	0.90%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,318,140	0.89%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,316,464	0.83%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,669,187	0.73%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,332,866	0.66%

91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,300,279	0.54%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,811,865	0.51%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,247,925	0.42%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,007,066	0.41%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,137,642	0.36%
91	GHEMA	23	HR A-	6,046,768	0.35%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,302,876	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,697,452	0.27%
91	NM	15	mxAA+	4,027,466	0.23%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,898,412	0.17%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	2,889,557	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,615,665	0.15%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,800,885	0.10%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,330,024	0.08%
91	GHOCB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	745,653	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	618,284	0.04%
91	DMXI	15	mxD	539,432	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,898	0.00%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>73,392,516</b>	<b>4.25%</b>
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,434,060	2.40%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	31,958,456	1.85%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>23,976,737</b>	<b>1.39%</b>
IISP	SHV	*	Alta	23,976,737	1.39%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>14,161,707</b>	<b>0.82%</b>
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,161,707	0.82%
	<b>Udibonos</b>			<b>500,445,226</b>	<b>28.94%</b>
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	236,240,857	13.66%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	163,855,083	9.48%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	78,354,686	4.53%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	21,994,601	1.27%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>52,976,164</b>	<b>3.06%</b>
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,692,989	0.68%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	7,789,625	0.45%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,853,402	0.40%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	6,836,202	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,335,375	0.37%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,490,599	0.32%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,912,239	0.23%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,340,454	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,725,279	0.10%

	<b>Reportos</b>			<b>109,938,507</b>	<b>6.36%</b>
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	109,938,507	6.36%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,729,093,625</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,734,411,607</b>	

**Cartera al: 28/06/2024**

**Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.542 %**  
**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."**