

## 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>937,656,916</b>	<b>12.22%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	688,019,501	8.97%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	187,342,724	2.44%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	62,294,692	0.81%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>603,831,690</b>	<b>7.87%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	603,831,690	7.87%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>69,224,170</b>	<b>0.90%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	69,224,170	0.90%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,974,758,364</b>	<b>38.77%</b>
91	AERMxCB	19	HR AA+	235,735,028	3.07%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,979,392	2.62%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	192,920,990	2.51%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,779,429	2.42%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	183,842,643	2.40%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	181,321,529	2.36%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	167,191,535	2.18%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	163,004,118	2.12%
91	GICSA	19	B/M	156,332,506	2.04%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	144,268,363	1.88%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	118,519,312	1.55%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	101,208,720	1.32%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,732,991	1.31%
91	TPLAYCB	20	HR AA	100,619,360	1.31%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	93,827,705	1.22%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	87,480,180	1.14%
91	CADU	20V	A/M	71,928,668	0.94%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	67,430,460	0.88%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	65,779,230	0.86%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,598,701	0.65%
91	GHEMA	23	HR A-	43,393,821	0.57%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	42,895,243	0.56%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	39,419,289	0.51%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	28,088,180	0.37%
91	VASCONI	22L	HR D	26,350,000	0.34%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,625,219	0.28%
91	GICSA	17	B/M	21,473,763	0.28%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,076,225	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,967,497	0.26%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,540,803	0.22%
91	VASCONI	19	HR D	14,642,748	0.19%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,798,756	0.13%
91	GICSA	15	B/M	1,985,961	0.03%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>136,220,416</b>	<b>1.78%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	126,654,510	1.65%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,565,906	0.13%
	<b>Chequera Euros</b>			<b>76,709</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		76,709	0.00%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>112,407,492</b>	<b>1.47%</b>
CHD	40-110	8377998		100,879,480	1.32%
CHD	40-133	8030298		11,528,013	0.15%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>190,804,849</b>	<b>2.49%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	190,804,849	2.49%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>419,776,349</b>	<b>5.47%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	419,776,349	5.47%
	<b>Opciones CALL Divisas</b>			<b>1,041,800</b>	<b>0.01%</b>
CALL	MXPUSD	240814		1,041,800	0.01%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>90,063,262</b>	<b>1.17%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,063,262	1.17%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>5,042,100</b>	<b>0.07%</b>
SWP	2TIEMXP	240802		-311,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-113,100	0.00%
SWP	2TIEMXP	290419		3,190,500	0.04%
SWP	2TIEMXP	290413		2,276,200	0.03%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>526,461,139</b>	<b>6.86%</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	431,694,054	5.63%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	94,767,085	1.24%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,516,823,600</b>	<b>19.77%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	663,063,377	8.64%

95	CFE	20-2	AAA (mex)	464,023,989	6.05%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	265,639,936	3.46%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	124,096,298	1.62%
	<b>Reportos</b>			<b>88,430,330</b>	<b>1.15%</b>
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	55,420,256	0.72%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	33,010,074	0.43%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,672,619,186</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,672,144,841</b>	

**Cartera al: 09/05/2024**

**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."**