

**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>1,043,128,136</b>	<b>13.82%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	664,062,013	8.80%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	181,278,086	2.40%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	134,589,428	1.78%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,198,610	0.84%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>602,395,402</b>	<b>7.98%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	602,395,402	7.98%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>67,404,525</b>	<b>0.89%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	67,404,525	0.89%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,888,756,401</b>	<b>38.27%</b>
91	AERMxCB	19	HR AA+	211,161,045	2.80%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,600,596	2.66%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	194,439,630	2.58%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,333,395	2.46%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	182,275,621	2.42%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,926,854	2.40%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	168,629,657	2.23%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	163,550,066	2.17%
91	GICSA	19	B/M	159,153,406	2.11%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,578,670	1.90%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	117,744,498	1.56%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,494,677	1.33%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	100,080,235	1.33%
91	TPLAYCB	20	HR AA	92,795,864	1.23%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	90,254,428	1.20%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	88,099,345	1.17%
91	CADU	20V	A/M	68,879,834	0.91%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	68,320,122	0.91%
91	LAMOSAS	19	AA (mex)	62,767,275	0.83%
91	IDEI	23+V	A/M	48,045,901	0.64%
91	GHEMA	23	HR A-	43,276,157	0.57%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,444,983	0.54%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	39,881,590	0.53%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	28,552,088	0.38%
91	GICSA	17	B/M	21,804,955	0.29%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	20,472,999	0.27%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,022,943	0.27%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,151,733	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,568,055	0.22%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,432,536	0.13%
91	GICSA	15	B/M	2,017,245	0.03%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>137,633,160</b>	<b>1.82%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	127,924,560	1.70%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,708,600	0.13%
<b>Chequera Euros</b>				<b>83,476</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		83,476	0.00%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>24,391,004</b>	<b>0.32%</b>
CHD	40-110	8377998		18,461,612	0.25%
CHD	40-133	8030298		5,929,391	0.08%
<b>Forward de Divisas</b>				<b>245,900</b>	<b>0.00%</b>
FWD	MXPUSD	240628		-461,380	-0.01%
FWD	MXPUSD	240628		707,280	0.01%
<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>				<b>186,858,911</b>	<b>2.48%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	186,858,911	2.48%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>				<b>420,186,408</b>	<b>5.57%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	420,186,408	5.57%
<b>Opciones CALL Divisas</b>				<b>5,535,700</b>	<b>0.07%</b>
CALL	MXPUSD	240814		5,535,700	0.07%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>90,721,729</b>	<b>1.20%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,721,729	1.20%
<b>Swaps Entregables</b>				<b>1,397,733</b>	<b>0.02%</b>
SWP	2TIEMXP	240802		-186,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-267,150	0.00%
SWP	1USDSUS	290613		-1,241,317	-0.02%
SWP	2TIEMXP	290606		2,546,500	0.03%
SWP	2TIEMXP	290419		450,500	0.01%
SWP	2TIEMXP	290413		95,200	0.00%
<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>				<b>95,539,485</b>	<b>1.27%</b>

JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,539,485	1.27%
	<b>Udibonos</b>			<b>50,140,372</b>	<b>0.66%</b>
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	50,140,372	0.66%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,526,901,129</b>	<b>20.23%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	667,195,049	8.84%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	475,845,534	6.30%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	257,781,508	3.42%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	126,079,038	1.67%
	<b>Reportos</b>			<b>406,836,518</b>	<b>5.39%</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	373,826,435	4.95%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	33,010,083	0.44%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,548,155,989</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,628,021,894</b>	

**Cartera al: 27/06/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.214 %**  
**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."**