

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			1,328,488,759	56.77%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	535,945,235	22.90%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	205,765,694	8.79%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	152,376,203	6.51%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	109,546,098	4.68%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	98,698,914	4.22%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	94,257,228	4.03%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	86,579,866	3.70%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	45,319,522	1.94%
	Certificados Bursátiles Corporativos			244,750,471	10.46%
91	LALA	18	AA (mex)	91,470,165	3.91%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,805,273	3.54%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	38,996,189	1.67%
91	BRX	22	AAA (mex)	20,275,217	0.87%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,203,627	0.48%
	Chequera Dolares			207	0.00%
CHD	40-133	8034712		207	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,013,482	1.71%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,013,482	1.71%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			20,160,384	0.86%
93	TPLAY	00223	HR2	20,160,384	0.86%
	Udibonos			16,021,439	0.69%
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	16,021,439	0.69%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			228,987,066	9.79%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	151,729,554	6.48%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	77,257,512	3.30%
	Reportos			461,612,902	19.73%

LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	461,612,902	19.73%
	TOTAL CARTERA			2,340,034,710	100.00%
	ACTIVO NETO			2,339,311,253	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.255 %
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."