

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			439,427,907	25.52%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	195,762,105	11.37%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	106,060,336	6.16%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	90,927,171	5.28%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,393,026	1.88%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,285,269	0.83%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			43,827,317	2.55%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	25,669,670	1.49%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,613,937	0.79%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,463,813	0.26%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	79,898	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			468,870,937	27.23%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	40,528,429	2.35%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,476,455	1.60%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,822,086	1.44%
91	OSM	15U	mxAA-	22,395,238	1.30%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,662,021	1.26%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,154,335	1.23%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,730,977	1.20%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,632,562	1.14%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,627,600	1.14%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,163,456	1.11%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,376,714	1.07%
91	SALUD	21	HR A+	18,000,744	1.05%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	17,875,223	1.04%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	17,842,828	1.04%
91	SALUD	20	HR A+	16,775,750	0.97%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,565,599	0.90%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,287,862	0.89%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,310,631	0.83%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,631,534	0.73%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,954,553	0.69%

91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,282,570	0.54%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,788,957	0.51%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,224,711	0.42%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,066,429	0.41%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,114,706	0.36%
91	GHEMA	23	HR A-	6,039,742	0.35%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,291,425	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,684,985	0.27%
91	NM	15	mxAA+	4,023,215	0.23%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,894,460	0.17%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	2,872,089	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,610,478	0.15%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,797,901	0.10%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,327,322	0.08%
91	GHOCB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	744,634	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	615,164	0.04%
91	DMXI	15	mxD	536,567	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,896	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			73,273,441	4.26%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,358,115	2.40%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	31,915,326	1.85%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			24,126,568	1.40%
IISP	SHV	*	Alta	24,126,568	1.40%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,157,958	0.82%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,157,958	0.82%
	Udibonos			496,194,871	28.82%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	233,831,413	13.58%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	162,855,492	9.46%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	77,594,446	4.51%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	21,913,520	1.27%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			52,771,364	3.07%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,621,155	0.68%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	7,740,944	0.45%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,830,626	0.40%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	6,825,579	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,324,055	0.37%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,473,333	0.32%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,894,860	0.23%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,338,137	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,722,674	0.10%

	Reportos			109,342,723	6.35%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	109,342,723	6.35%
	TOTAL CARTERA			1,721,993,086	100.00%
	ACTIVO NETO			1,722,327,575	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.541 %
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."