

## 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>931,211,076</b>	<b>12.16%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	683,146,650	8.92%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	185,953,222	2.43%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	62,111,205	0.81%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>602,513,827</b>	<b>7.87%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	602,513,827	7.87%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>69,030,653</b>	<b>0.90%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	69,030,653	0.90%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,988,516,515</b>	<b>39.02%</b>
91	AERMxCB	19	HR AA+	235,156,730	3.07%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,506,494	2.62%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	191,434,306	2.50%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,234,295	2.42%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	182,504,262	2.38%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,919,373	2.36%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	165,862,963	2.17%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	161,861,386	2.11%
91	GICSA	19	B/M	154,885,604	2.02%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,893,952	1.88%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	117,679,740	1.54%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,495,825	1.31%
91	TPLAYCB	20	HR AA	100,357,762	1.31%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	100,215,387	1.31%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	93,398,982	1.22%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	86,907,490	1.14%
91	CADU	20V	A/M	71,334,482	0.93%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	70,699,325	0.92%
91	LAMOS A	19	AA (mex)	65,265,573	0.85%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,461,360	0.65%
91	GHEMA	23	HR A-	43,276,157	0.57%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	42,786,395	0.56%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	39,128,917	0.51%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	27,969,957	0.37%
91	VASCONI	22L	HR D	26,350,000	0.34%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	25,690,184	0.34%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,459,546	0.28%
91	GICSA	17	B/M	21,276,694	0.28%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,022,943	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,826,842	0.26%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,409,740	0.21%
91	VASCONI	19	HR D	14,521,727	0.19%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,755,373	0.13%
91	GICSA	15	B/M	1,966,750	0.03%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>135,561,569</b>	<b>1.77%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	126,017,085	1.65%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,544,484	0.13%
	<b>Chequera Euros</b>			<b>77,234</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		77,234	0.00%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>112,474,256</b>	<b>1.47%</b>
CHD	40-110	8377998		101,993,059	1.33%
CHD	40-133	8030298		10,481,197	0.14%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>190,397,633</b>	<b>2.49%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	190,397,633	2.49%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>416,599,109</b>	<b>5.44%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	416,599,109	5.44%
	<b>Opciones CALL Divisas</b>			<b>1,560,630</b>	<b>0.02%</b>
CALL	MXPUSD	240814		1,560,630	0.02%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>90,722,002</b>	<b>1.18%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,722,002	1.18%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>1,771,100</b>	<b>0.02%</b>
SWP	2TIEMXP	240802		-359,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-219,700	0.00%
SWP	2TIEMXP	290419		1,456,000	0.02%
SWP	2TIEMXP	290413		893,800	0.01%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>526,160,348</b>	<b>6.87%</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	430,758,051	5.62%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,402,297	1.25%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,517,138,997</b>	<b>19.81%</b>

95	PEMEX	19	mxAAA	667,788,832	8.72%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	461,228,076	6.02%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	264,303,233	3.45%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	123,818,857	1.62%
	<b>Reportos</b>			<b>76,210,404</b>	<b>1.00%</b>
BI	CETES	241003	AAA(mex)	62,144,179	0.81%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	10,878,100	0.14%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	3,188,125	0.04%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,659,945,353</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,654,358,724</b>	

**Cartera al:** 02/05/2024

**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."