

## 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>879,393,887</b>	<b>11.26%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	633,251,639	8.11%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	184,541,998	2.36%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	61,600,250	0.79%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>603,996,256</b>	<b>7.74%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	603,996,256	7.74%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>68,602,573</b>	<b>0.88%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	68,602,573	0.88%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>3,019,508,060</b>	<b>38.68%</b>
91	AERMXCB	19	HR AA+	247,582,598	3.17%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	201,045,772	2.58%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	190,620,588	2.44%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,669,764	2.38%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	181,796,219	2.33%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	181,349,789	2.32%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	165,102,955	2.12%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	160,113,920	2.05%
91	GICSA	19	B/M	153,563,037	1.97%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	144,370,974	1.85%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	118,309,463	1.52%
91	TPLAYCB	20	HR AA	108,741,038	1.39%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,751,203	1.29%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	99,293,844	1.27%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	92,810,488	1.19%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	90,993,419	1.17%
91	CADU	20V	A/M	70,986,081	0.91%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	70,378,002	0.90%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	64,963,825	0.83%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,581,535	0.64%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	44,421,028	0.57%
91	GHEMA	23	HR A-	43,401,451	0.56%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	41,139,509	0.53%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	27,802,721	0.36%
91	VASCONI	22L	HR D	26,350,000	0.34%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	25,509,571	0.33%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,331,350	0.27%
91	GICSA	17	B/M	21,076,295	0.27%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,076,123	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,756,798	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	17,077,424	0.22%
91	VASCONI	19	HR D	14,642,748	0.19%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,715,581	0.12%
91	CADU	19	HR BBB	7,231,367	0.09%
91	GICSA	15	B/M	1,951,582	0.03%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>135,143,896</b>	<b>1.73%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	125,657,865	1.61%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,486,031	0.12%
	<b>Chequera Euros</b>			<b>74,708</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		74,708	0.00%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>108,901,365</b>	<b>1.40%</b>
CHD	40-110	8377998		98,764,193	1.27%
CHD	40-133	8030298		10,137,172	0.13%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>189,022,173</b>	<b>2.42%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	189,022,173	2.42%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>413,253,605</b>	<b>5.29%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	413,253,605	5.29%
	<b>Opciones CALL Divisas</b>			<b>840,240</b>	<b>0.01%</b>
CALL	MXPUSD	240814		840,240	0.01%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>90,063,434</b>	<b>1.15%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,063,434	1.15%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-1,467,600</b>	<b>-0.02%</b>
SWP	2TIEMXP	240426		-698,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-507,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		-262,600	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>525,849,586</b>	<b>6.74%</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	431,082,611	5.52%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	94,766,975	1.21%
	<b>Udibonos</b>			<b>47,845,310</b>	<b>0.61%</b>

S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	47,845,310	0.61%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,527,182,225</b>	<b>19.56%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	663,488,813	8.50%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	478,031,994	6.12%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	262,837,492	3.37%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	122,823,926	1.57%
	<b>Reportos</b>			<b>199,043,746</b>	<b>2.55%</b>
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	126,021,420	1.61%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	73,022,326	0.94%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,807,253,464</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,788,804,874</b>	

**Cartera al: 11/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.129 %**  
**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."**