

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			923,900,925	11.90%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	678,912,281	8.75%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	183,281,736	2.36%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	61,706,909	0.80%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			599,883,958	7.73%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	599,883,958	7.73%
	Certificados Bursátiles Bancarios			68,700,307	0.89%
94	COMPART	20	AA (mex)	68,700,307	0.89%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,985,977,963	38.46%
91	AERMxCB	19	HR AA+	234,003,245	3.01%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	201,519,202	2.60%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	190,045,710	2.45%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,102,789	2.40%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	181,133,349	2.33%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,116,932	2.32%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	164,608,447	2.12%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	159,154,421	2.05%
91	GICSA	19	B/M	153,306,074	1.98%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,147,225	1.84%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	116,847,643	1.51%
91	TPLAYCB	20	HR AA	109,024,825	1.40%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,989,171	1.30%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	98,706,017	1.27%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	92,776,076	1.20%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	86,135,110	1.11%
91	CADU	20V	A/M	70,770,147	0.91%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	70,309,092	0.91%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	64,607,691	0.83%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,719,352	0.64%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	44,534,138	0.57%
91	GHEMA	23	HR A-	43,041,595	0.55%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,945,950	0.53%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	27,796,302	0.36%
91	VASCONI	22L	HR D	26,350,000	0.34%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	25,569,672	0.33%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,234,896	0.27%
91	GICSA	17	B/M	20,999,623	0.27%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,129,608	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,698,267	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,245,734	0.21%
91	VASCONI	19	HR D	14,763,769	0.19%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,699,037	0.13%
91	GICSA	15	B/M	1,946,854	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			135,016,419	1.74%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	125,511,525	1.62%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,504,894	0.12%
	Chequera Euros			76,918	0.00%
CHE	40-012	5514622		76,918	0.00%
	Chequera Dolares			113,111,397	1.46%
CHD	40-110	8377998		102,591,255	1.32%
CHD	40-133	8030298		10,520,142	0.14%
	Titulos de Credito Extranjeros			189,431,202	2.44%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	189,431,202	2.44%
	Eurobonos de Empresas Privadas			410,487,386	5.29%
D2	CAF872	310222	AA-	410,487,386	5.29%
	Opciones CALL Divisas			2,095,400	0.03%
CALL	MXPUSD	240814		2,095,400	0.03%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			90,282,555	1.16%
93	TPLAY	00223	HR2	90,282,555	1.16%
	Swaps Entregables			-848,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240426		-699,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240802		-330,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		-280,800	0.00%
SWP	2TIEMXP	290413		461,800	0.01%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			526,998,891	6.79%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	432,020,475	5.57%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	94,978,416	1.22%
	Udibonos			46,248,869	0.60%

S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	46,248,869	0.60%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,530,053,452	19.71%
95	PEMEX	19	mxAAA	664,988,392	8.57%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	479,284,275	6.17%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	262,579,888	3.38%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	123,200,897	1.59%
	Reportos			142,147,872	1.83%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	73,022,303	0.94%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	69,125,569	0.89%
	TOTAL CARTERA			7,763,565,014	100.00%
	ACTIVO NETO			7,756,392,471	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.145 %
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."