

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			440,850,501	26.32%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	205,616,800	12.28%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	94,688,528	5.65%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	94,264,078	5.63%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,182,380	1.92%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,098,716	0.84%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			44,193,553	2.64%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	25,672,605	1.53%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,905,349	0.83%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,537,088	0.27%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	78,511	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			482,584,180	28.81%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	41,547,043	2.48%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,389,055	1.64%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,622,238	1.47%
91	OSM	15U	mxAA-	22,305,166	1.33%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,368,966	1.28%
91	GAP	23-2L	mxAAA	20,962,382	1.25%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,505,750	1.22%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,165,735	1.20%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,256,145	1.15%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,064,109	1.14%
91	LAMOSIA	19	AA (mex)	18,586,703	1.11%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,430,926	1.10%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,241,154	1.09%
91	SALUD	21	HR A+	17,994,083	1.07%
91	SALUD	20	HR A+	16,785,787	1.00%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,114,610	0.96%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,086,373	0.90%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,162,871	0.85%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,456,931	0.74%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,828,573	0.71%

91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,605,984	0.57%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,471,224	0.51%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,114,277	0.43%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,066,429	0.42%
91	GHOCB	14	HR C	6,728,622	0.40%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,247,732	0.37%
91	GHEMA	23	HR A-	6,039,742	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,221,975	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,733,882	0.28%
91	VASCONI	22L	HR D	4,650,000	0.28%
91	NM	15	mxAA+	3,960,274	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,741,839	0.22%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,844,879	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,660,238	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,860,511	0.11%
91	VASCONI	19	HR D	1,633,730	0.10%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,298,115	0.08%
91	OSM	15	mxAA-	731,799	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	613,388	0.04%
91	DMXI	15	mxD	483,080	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,862	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			72,268,251	4.32%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	40,803,430	2.44%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	31,464,821	1.88%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,732,846	0.88%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,732,846	0.88%
	Udibonos			511,786,604	30.56%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	240,018,124	14.33%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	165,848,372	9.90%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	50,954,155	3.04%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	32,655,937	1.95%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	22,310,016	1.33%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			53,580,507	3.20%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,873,743	0.71%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	7,918,026	0.47%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	6,945,696	0.42%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,741,619	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,450,727	0.39%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,568,061	0.33%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,964,527	0.24%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,296,222	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,821,885	0.11%

	Reportos			54,857,962	3.28%
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	54,857,962	3.28%
	TOTAL CARTERA			1,674,854,404	100.00%
	ACTIVO NETO			1,674,938,062	
	Cartera al:	02/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.483 %
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."