

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			450,994,353	26.93%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	211,124,964	12.61%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	114,635,634	6.85%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	78,406,748	4.68%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,656,712	1.95%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,170,296	0.85%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			48,675,530	2.91%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	29,843,438	1.78%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,256,250	0.85%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,498,071	0.27%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	77,772	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			478,687,803	28.59%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	47,178,177	2.82%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,925,432	1.67%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,884,698	1.49%
91	OSM	15U	mxAA-	22,755,161	1.36%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,679,770	1.35%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,308,735	1.27%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,818,461	1.24%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,791,341	1.24%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,136,520	1.14%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,110,695	1.14%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,875,256	1.13%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,577,242	1.11%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,463,995	1.10%
91	SALUD	21	HR A+	17,966,797	1.07%
91	SALUD	20	HR A+	16,768,522	1.00%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,283,405	0.97%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,402,420	0.86%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,617,256	0.75%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	12,014,123	0.72%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,571,264	0.57%

91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,589,938	0.51%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,132,810	0.43%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,058,208	0.42%
91	GHOCEB	14	HR C	6,769,915	0.40%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,327,432	0.38%
91	GHEMA	23	HR A-	6,031,424	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,258,543	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,716,421	0.28%
91	VASCONI	22L	HR D	4,650,000	0.28%
91	NM	15	mxAA+	3,932,325	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,852,184	0.23%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,834,218	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,727,284	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,858,874	0.11%
91	VASCONI	19	HR D	1,681,430	0.10%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,325,578	0.08%
91	OSM	15	mxAA-	728,988	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	628,600	0.04%
91	DMXI	15	mxD	452,516	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,845	0.00%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			32,951,756	1.97%
IISP	SHV	*	Alta	32,951,756	1.97%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			15,016,096	0.90%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	15,016,096	0.90%
	Udibonos			574,710,422	34.32%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	350,241,539	20.92%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	168,727,759	10.08%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	33,092,120	1.98%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	22,649,004	1.35%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			54,734,282	3.27%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	12,199,178	0.73%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	8,134,745	0.49%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	7,128,777	0.43%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,754,181	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,658,983	0.40%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,618,314	0.34%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,085,073	0.24%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,271,600	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,883,430	0.11%
	Reportos			18,734,328	1.12%
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	18,734,328	1.12%

TOTAL CARTERA	1,674,504,570	100.00%
ACTIVO NETO	1,703,166,883	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.501 %
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."