

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			435,796,262	25.88%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	202,892,252	12.05%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	111,053,701	6.60%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	75,772,308	4.50%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,026,817	1.90%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,051,184	0.84%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			44,726,969	2.66%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,036,154	1.55%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,104,906	0.84%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,507,898	0.27%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	78,012	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			468,230,362	27.81%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	41,922,504	2.49%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,678,049	1.64%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	24,775,314	1.47%
91	OSM	15U	mxAA-	22,567,722	1.34%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,373,621	1.33%
91	GAP	23-2L	mxAAA	20,847,326	1.24%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,356,688	1.21%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	20,045,605	1.19%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,109,994	1.14%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	18,975,095	1.13%
91	LAMOSIA	19	AA (mex)	18,500,769	1.10%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,363,878	1.09%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,345,356	1.09%
91	SALUD	21	HR A+	18,041,589	1.07%
91	SALUD	20	HR A+	16,653,545	0.99%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,044,682	0.95%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,009,968	0.83%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,416,686	0.74%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,714,694	0.70%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,545,458	0.57%

91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,414,081	0.50%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,083,304	0.42%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,016,553	0.42%
91	GHOCEB	14	HR C	6,641,176	0.39%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,294,475	0.37%
91	GHEMA	23	HR A-	6,057,228	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,195,415	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,705,175	0.28%
91	VASCONI	22L	HR D	4,650,000	0.28%
91	NM	15	mxAA+	3,936,246	0.23%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,805,635	0.23%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,830,225	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,684,336	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,852,055	0.11%
91	VASCONI	19	HR D	1,647,345	0.10%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,313,491	0.08%
91	OSM	15	mxAA-	727,995	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	622,211	0.04%
91	DMXI	15	mxD	463,023	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,849	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			31,361,332	1.86%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	31,361,332	1.86%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,579,145	0.87%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,579,145	0.87%
	Udibonos			569,361,866	33.82%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	347,974,538	20.67%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	165,972,326	9.86%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	32,904,084	1.95%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	22,510,918	1.34%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			54,243,481	3.22%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	12,001,861	0.71%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	8,003,133	0.48%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	7,097,309	0.42%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,709,437	0.40%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,618,077	0.39%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,597,954	0.33%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,052,725	0.24%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,277,771	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,885,214	0.11%
	Reportos			65,347,452	3.88%
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	65,347,452	3.88%

TOTAL CARTERA	1,683,646,869	100.00%
ACTIVO NETO	1,680,895,239	

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.507 %
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."
