

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			700,091,379	8.89%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	543,878,619	6.91%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	94,622,256	1.20%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	61,590,504	0.78%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			601,924,644	7.64%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	601,924,644	7.64%
	Certificados Bursátiles Bancarios			68,579,389	0.87%
94	COMPART	20	AA (mex)	68,579,389	0.87%
	Certificados Bursátiles Corporativos			3,060,738,874	38.87%
91	AERMxCB	19	HR AA+	246,628,235	3.13%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	202,239,630	2.57%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	192,866,680	2.45%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,762,111	2.37%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	183,482,641	2.33%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,717,700	2.30%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	167,065,340	2.12%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	164,599,082	2.09%
91	GICSA	19	B/M	163,140,117	2.07%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,782,322	1.83%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	119,658,372	1.52%
91	TPLAYCB	20	HR AA	117,405,987	1.49%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	103,067,642	1.31%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,378,472	1.28%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	93,061,398	1.18%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	92,238,524	1.17%
91	CADU	20V	A/M	71,851,666	0.91%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	70,637,115	0.90%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	66,278,803	0.84%
91	IDEI	23+V	AA- (mex)	49,909,219	0.63%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	44,243,939	0.56%
91	GHEMA	23	HR A-	43,216,559	0.55%

91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	41,257,879	0.52%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	27,866,325	0.35%
91	VASCONI	22L	HR D	26,350,000	0.34%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	25,661,014	0.33%
91	GICSA	17	B/M	23,028,070	0.29%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,721,728	0.28%
91	BEGRAND	23	HR A+	20,209,941	0.26%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,979,071	0.25%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	17,433,066	0.22%
91	VASCONI	19	HR D	14,945,721	0.19%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,766,839	0.12%
91	CADU	19	HR BBB	7,198,839	0.09%
91	GICSA	15	B/M	2,088,827	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			135,493,692	1.72%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	126,037,005	1.60%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,456,687	0.12%
	Chequera Euros			75,897	0.00%
CHE	40-012	5514622		75,897	0.00%
	Chequera Dolares			107,754,992	1.37%
CHD	40-110	8377998		99,795,850	1.27%
CHD	40-133	8030298		7,959,142	0.10%
	Titulos de Credito Extranjeros			188,500,935	2.39%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	188,500,935	2.39%
	Eurobonos de Empresas Privadas			423,692,636	5.38%
D2	CAF872	310222	AA-	423,692,636	5.38%
	Opciones CALL Divisas			940,090	0.01%
CALL	MXPUSD	240814		940,090	0.01%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			90,611,609	1.15%
93	TPLAY	00223	HR2	90,611,609	1.15%
	Swaps Entregables			1,037,350	0.01%
SWP	2TIEMXP	240426		-1,670,000	-0.02%
SWP	2TIEMXP	240802		-387,500	-0.01%
SWP	1MXPTIE	330303		2,018,800	0.03%
SWP	1MXPTIE	331117		990,900	0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		85,150	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			529,186,854	6.72%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	433,889,230	5.51%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,297,624	1.21%

	Udibonos			48,514,295	0.62%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	48,514,295	0.62%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,537,733,952	19.53%
95	PEMEX	19	mxAAA	667,538,447	8.48%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	482,793,166	6.13%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	264,911,166	3.36%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	122,491,172	1.56%
	Reportos			380,050,289	4.83%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	380,050,289	4.83%
	TOTAL CARTERA			7,874,926,877	100.00%
	ACTIVO NETO			7,895,571,430	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.105 %
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."