

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				435,561,211	28.03%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	294,045,394	18.92%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	87,241,851	5.61%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	35,354,292	2.28%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	18,919,673	1.22%
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				47,149,829	3.03%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	28,912,196	1.86%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,748,314	0.89%
CD	BACMEX	14	AAA (mex)	4,413,014	0.28%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	76,306	0.01%
Certificados Bursátiles Corporativos				484,715,167	31.19%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	44,826,744	2.88%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,762,251	1.79%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	27,553,126	1.77%
91	ARA	23-2X	AA (mex)	22,160,672	1.43%
91	OSM	15U	mxAA-	21,576,988	1.39%
91	GAP	23-2L	mxAAA	20,695,704	1.33%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	20,443,135	1.32%
91	ORBA	22-2L	AAA (mex)	20,164,058	1.30%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	19,809,294	1.28%
91	MEDICA	20	AA (mex)	18,669,981	1.20%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	18,408,406	1.18%
91	LAMOS	19	AA (mex)	18,323,145	1.18%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,045,055	1.16%
91	SALUD	21	HR A+	17,918,683	1.15%
91	SALUD	20	HR A+	16,773,669	1.08%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,774,663	1.02%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	13,863,977	0.89%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,135,472	0.78%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,669,537	0.75%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	10,863,695	0.71%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,353,969	0.60%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,375,041	0.54%
91	MAYACB	12U	AA (mex)	7,371,383	0.47%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,089,870	0.46%
91	DANHOS	16	AA (mex)	6,913,753	0.45%
91	GHENIA	23	HR A-	6,023,742	0.39%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,020,043	0.39%
91	GHOCB	14	HR C	5,997,888	0.39%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,136,981	0.33%
91	VASCONI	22L	HR D	4,650,000	0.30%
91	TENEXCB	14U	AAA (mex)	4,236,961	0.27%
91	NM	15	mxAA+	3,888,702	0.25%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,755,656	0.18%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,752,834	0.18%
91	ALSEA	19-2	HR A-	1,804,479	0.12%
91	VASCONI	19	HR D	1,676,615	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,339,761	0.09%
91	OSM	15	mxAA-	714,277	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	607,380	0.04%
91	DMXI	15	mxD	465,636	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,809	0.00%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comerc				15,086,469	0.97%
93	TPLAY	00222	HR2	15,086,469	0.97%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				14,551,040	0.94%
J1	CABEI	2-23S	mxAAA	14,551,040	0.94%
Udibonos				417,985,399	26.90%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	267,972,052	17.24%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	90,151,862	5.80%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	24,918,723	1.60%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	20,088,108	1.29%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	14,854,654	0.96%
Certif. Burs. Emit. Entidades o Inst. del Gobierno Federa				112,700,405	7.25%
95	FEFA	16-2	mxAAA	30,553,875	1.97%
95	FOVSCB	19U	Aaa.mx	17,263,101	1.11%
95	CFE	15U	AAA (mex)	12,483,310	0.80%
95	FOVSCB	17U	AAA (mex)	9,594,917	0.61%
95	TFOVCB	20U	AAA (mex)	8,008,765	0.52%
95	TFOVCB	15-2U	AAA (mex)	7,525,484	0.48%
95	FOVSCB	17-2U	Aaa.mx	6,963,788	0.45%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,418,644	0.41%
95	FOVSCB	19-2U	AAA (mex)	4,040,601	0.26%
95	CDVITOT	13-2U	mxAA+	2,220,713	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	2,207,894	0.14%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,202,486	0.14%
95	CDVITOT	14-2U	AA+ (mex)	1,208,234	0.08%
95	CEDEVIS	12U	AAA (mex)	1,180,193	0.08%
95	CDVITOT	15U	mxAAA	389,865	0.03%
95	CDVITOT	11-3U	AAA (mex)	302,515	0.02%
95	CDVITOT	11U	AAA (mex)	220,019	0.01%
Reportos				26,398,074	1.70%
LD	BONDES	250619	AAA(mex)	26,398,074	1.70%
TOTAL CARTERA				1,554,147,594	100.00%
ACTIVO NETO				1,583,047,814	
Cartera al: 12/10/2023					

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.548 %
 Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 día 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 este fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afectan 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 simultánea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."