

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			437,805,454	27.54%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	245,509,418	15.44%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	84,852,853	5.34%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	65,059,370	4.09%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	42,383,813	2.67%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			46,674,235	2.94%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	28,533,700	1.80%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,632,611	0.86%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,431,202	0.28%
CD	BANOB	17-2X	AAA (mex)	76,722	0.01%
	Certificados Bursátiles Corporativos			483,440,496	30.41%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	44,906,408	2.83%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	27,628,275	1.74%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,511,452	1.73%
91	OSM	15U	mxAA-	21,588,787	1.36%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	20,959,753	1.32%
91	GAP	23-2L	mxAAA	20,503,108	1.29%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	20,490,056	1.29%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,885,361	1.25%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	19,816,340	1.25%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,028,544	1.20%
91	MEDICA	20	AA (mex)	18,742,490	1.18%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,199,130	1.15%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,105,845	1.14%
91	SALUD	21	HR A+	18,050,117	1.14%
91	SALUD	20	HR A+	16,711,598	1.05%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,764,209	0.99%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	13,807,990	0.87%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,173,631	0.77%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,519,050	0.73%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	10,993,547	0.69%
91	AXO	19-2	A+ (mex)	9,401,441	0.59%

91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,305,801	0.52%
91	MAYACB	12U	AA (mex)	7,328,925	0.46%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,048,255	0.44%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	6,971,749	0.44%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,032,274	0.38%
91	GHEMA	23	HR A-	6,002,401	0.38%
91	GHO CB	14	HR C	5,950,514	0.37%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,121,262	0.32%
91	VASCONI	22L	HR D	4,650,000	0.29%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	4,233,242	0.27%
91	NM	15	mxAA+	3,900,103	0.25%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,773,605	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,705,020	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,826,326	0.12%
91	VASCONI	19	HR D	1,658,352	0.10%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,335,447	0.08%
91	OSM	15	mxAA-	717,167	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	607,291	0.04%
91	DMXI	15	mx D	483,811	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,816	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			15,037,859	0.95%
93	TPLAY	00222	HR2	15,037,859	0.95%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,306,389	0.90%
Jl	CABEI	2-23S	mxAAA	14,306,389	0.90%
	Udibonos			444,854,624	27.99%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	251,574,956	15.83%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	88,376,433	5.56%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	45,029,391	2.83%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	24,941,872	1.57%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	19,999,821	1.26%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	14,932,150	0.94%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			111,439,669	7.01%
95	FEFA	16-2	mxAAA	30,643,519	1.93%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	17,055,151	1.07%
95	CFE	15U	AAA (mex)	12,520,072	0.79%
95	FOVISCB	17U	AAA (mex)	9,328,725	0.59%
95	TFOVICB	20U	AAA (mex)	7,912,216	0.50%
95	TFOVICB	15-2U	AAA (mex)	7,406,603	0.47%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,840,204	0.43%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,519,835	0.41%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,998,724	0.25%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,225,307	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	2,144,531	0.14%

95	CDVITOT	13-2U	mxAA+	1,528,524	0.10%
95	CDVITOT	14-2U	AA+ (mex)	1,215,242	0.08%
95	CEDEVIS	12U	AAA (mex)	1,184,529	0.08%
95	CDVITOT	15U	mxAAA	391,219	0.03%
95	CDVITOT	11-3U	AAA (mex)	304,205	0.02%
95	CDVITOT	11U	AAA (mex)	221,062	0.01%
	Reportos			36,081,403	2.27%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	36,081,403	2.27%
	TOTAL CARTERA			1,589,640,129	100.00%
	ACTIVO NETO			1,553,617,163	

Cartera al: 31/10/2023

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.543 %
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."