

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Corto Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Reportos			9,707,661,778	100.00%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	163,592,244	1.69%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	398,921,624	4.11%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	3,139,290,633	32.34%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	1,180,283,291	12.16%
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	958,288,303	9.87%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	601,198,487	6.19%
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	900,847,429	9.28%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	1,264,841,696	13.03%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	502,965,909	5.18%
LF	BONDESF	290125	AAA(mex)	597,432,162	6.15%
	TOTAL CARTERA			9,707,661,778	100.00%
	ACTIVO NETO			9,695,118,270	
	Cartera al:	29/09/2023			

Límite Máximo de VaR: 0.03%
Var Promedio: 0.0010%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión de Renta Variable
Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			58,810,870	88.89%
1	AC	*	Alta	1,139,616	1.72%
1	ALFA	A	Alta	2,268,000	3.43%
1	ALPEK	A	Alta	2,401,080	3.63%
1	ALSEA	*	Alta	1,280,882	1.94%
1	AMX	B	Alta	11,166,600	16.88%
1	CEMEX	CPO	Alta	8,243,250	12.46%
1	CTAXTEL	A	Media	83,600	0.13%
1	FEMSA	UBD	Alta	12,561,780	18.99%
1	KOF	UBL	Alta	2,243,192	3.39%
1	LASITE	B-1	Media	1,134,690	1.72%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	5,260,675	7.95%
1	NEMAK	A	Media	4,907,750	7.42%
1	ORBIA	*	Alta	832,830	1.26%
1	PE&OLES	*	Alta	924,525	1.40%
1	WALMEX	*	Alta	4,362,400	6.59%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			1,544,520	2.33%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	1,544,520	2.33%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,537,067	3.84%
1ISP	EWV	*	Alta	2,537,067	3.84%
	Reportos			3,269,299	4.94%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	3,269,299	4.94%
	TOTAL CARTERA			66,161,755	100.00%
	ACTIVO NETO			66,032,254	
	Cartera al:	29/09/2023			

Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.3962%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión de Renta Variable
Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Extranjeras de Emisiones Extranjeras			343,019	0.16%
1E	SAN	*	Baja	343,019	0.16%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			5,442,106	2.48%
1ASP	BABA	N	Alta	5,442,106	2.48%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			207,436,249	94.70%
1ISP	EEM	*	Alta	23,280,886	10.63%
1ISP	EUFN	*	Alta	13,231,898	6.04%
1ISP	EWC	*	Alta	2,215,923	1.01%
1ISP	EWG	*	Alta	6,301,232	2.88%
1ISP	EWI	*	Alta	6,945,053	3.17%
1ISP	EWJ	*	Alta	19,018,178	8.68%
1ISP	EWP	*	Alta	5,415,720	2.47%
1ISP	EZU	*	Alta	21,569,327	9.85%
1ISP	FXI	*	Alta	6,842,960	3.12%
1ISP	GLD	*	Alta	3,286,815	1.50%
1ISP	HEDJ	*	Alta	12,184,716	5.56%
1ISP	IVV	*	Alta	38,542,925	17.60%
1ISP	MCHI	*	Alta	10,411,462	4.75%
1ISP	QQQ	*	Alta	11,988,276	5.47%
1ISP	SHV	*	Alta	3,850,520	1.76%
1ISP	XLE	*	Alta	3,150,616	1.44%
1ISP	XLF	*	Alta	15,666,061	7.15%
1ISP	XLI	*	Alta	3,533,681	1.61%
	Reportos			5,830,622	2.66%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	5,830,622	2.66%
	TOTAL CARTERA			219,051,996	100.00%
	ACTIVO NETO			217,988,176	
	Cartera al:		29/09/2023		

Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.5852%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."**

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Discrecional Deuda

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				30,840,682	6.21%
94	BANORTE	23-4	mxAAA	10,057,850	2.03%
94	BLADEX	21	AAA (mex)	10,727,385	2.16%
94	SCOTIAB	23	AAA (mex)	10,055,447	2.02%
Certificados Bursátiles Corporativos				170,521,503	34.33%
91	AMX	22	AAA (mex)	10,087,728	2.03%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,039,659	3.03%
91	BACHOCO	22	AAA (mex)	10,009,584	2.02%
91	DONDE	20	HR AA	9,908,950	2.00%
91	ECREDCB	22	mxAAA	10,067,695	2.03%
91	FEMSA	22L	AAA (mex)	10,041,852	2.02%
91	GAP	19	mxAAA	15,136,987	3.05%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	10,090,297	2.03%
91	GPH	22	AAA (mex)	10,051,101	2.02%
91	GRUMA	22	mxAA+	10,065,277	2.03%
91	KIMBER	22-2	AAA (mex)	10,009,961	2.02%
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	9,841,375	1.98%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,092,596	3.04%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,017,132	3.02%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	10,061,310	2.03%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				0	0.00%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				43,888,564	8.84%
1ISP	FRMXNX	N	ALTA	33,333,750	6.71%
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	10,554,814	2.13%
Udibonos				25,004,523	5.03%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	25,004,523	5.03%
Certificados De La Tesorería De La Federación				39,153,465	7.88%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	8,933,134	1.80%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	17,566,370	3.54%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	12,653,961	2.55%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				37,686,127	7.59%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	12,229,954	2.46%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	25,456,173	5.12%
Reportos				149,673,322	30.13%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	149,673,322	30.13%
TOTAL CARTERA				496,768,186	100.00%
ACTIVO NETO				496,409,802	
Cartera al:		29/09/2023			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.0670%
Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.
Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.
El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.
***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.**
Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Discrecional en Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Udibonos			75,185,001	41.28%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	30,930,076	16.98%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	33,596,832	18.45%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,658,094	5.85%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			36,354,927	19.96%
BI	CETES	231116	AAA(mex)	4,930,207	2.71%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	8,933,134	4.91%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	8,783,185	4.82%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	8,646,817	4.75%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	5,061,584	2.78%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			19,048,572	10.46%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	12,229,954	6.72%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	6,818,618	3.74%
	Reportos			51,526,651	28.29%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	51,526,651	28.29%
	TOTAL CARTERA			182,115,150	100.00%
	ACTIVO NETO			181,958,069	

Cartera al: 29/09/2023
Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.2213%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Corto Plazo

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda			776,655,135	7.98%
51	+TASA	FF	AAA/1(mex)	776,655,135	7.98%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,700,946,401	17.48%
BI	CETES	231005	AAA(mex)	199,812,240	2.05%
BI	CETES	231019	AAA(mex)	198,943,120	2.05%
BI	CETES	231101	AAA(mex)	198,144,140	2.04%
BI	CETES	231116	AAA(mex)	192,278,054	1.98%
BI	CETES	231130	AAA(mex)	167,131,043	1.72%
BI	CETES	231214	AAA(mex)	439,858,710	4.52%
BI	CETES	231228	AAA(mex)	243,296,800	2.50%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	61,482,295	0.63%
	Reportos			7,251,161,725	74.53%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	2,629,224,673	27.03%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	644,963,247	6.63%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	336,991,057	3.46%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	3,639,982,749	37.42%
	TOTAL CARTERA			9,728,763,262	100.00%
	ACTIVO NETO			9,720,766,457	

Cartera al: 29/09/2023
Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0041%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				1,556,930,097	28.71%
FSP	BACMEXT	D23008	F1+ (mex)	142,745,548	2.63%
FSP	BACMEXT	D23009	F1+ (mex)	143,612,295	2.65%
FSP	NAFIN	D23056	F1+ (mex)	143,148,180	2.64%
FSP	NAFIN	D23058	F1+ (mex)	143,050,598	2.64%
FSP	NAFIN	D23060	F1+ (mex)	142,883,905	2.64%
FSP	NAFIN	D23063	F1+ (mex)	143,794,381	2.65%
FSP	NAFIN	D23065	F1+ (mex)	143,669,192	2.65%
FSP	NAFIN	D23068	F1+ (mex)	143,370,896	2.64%
FSP	NAFIN	D23069	F1+ (mex)	267,366,818	4.93%
FSP	NAFIN	D23070	F1+ (mex)	143,288,285	2.64%
Track de Deuda Corporativa				41,525,000	0.77%
1C	DLRTRAC	15	N/A	41,525,000	0.77%
Chequera Dolares				3,331,292,945	61.43%
CHD	BACMEXT	4006562	N/A	845,592,649	15.59%
CHD	NAFIN	6009236	N/A	1,182,674,438	21.81%
CHD	CITIBNM	9409199	N/A	261,419	0.01%
CHD	BACOMER	6539459	N/A	590,373,109	10.89%
CHD	SCOTIAB	0941285	N/A	712,391,331	13.14%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				492,982,204	9.09%
1ISP	IB01	N	N/A	492,982,204	9.09%
TOTAL CARTERA				5,422,730,247	100.00%
ACTIVO NETO				5,418,947,471	
Cartera al:		29/09/2023			

Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.0243%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV