

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			9,184,982,668	100.00%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	887,046,823	9.66%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	482,324,409	5.25%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,367,185,341	14.89%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	3,534,311,841	38.48%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	716,303,019	7.80%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	297,892,617	3.24%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	399,460,275	4.35%
LF	BONDESF	290125	AAA(mex)	612,266,916	6.67%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	500,153,105	5.45%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	388,038,322	4.23%
	TOTAL CARTERA			9,184,982,668	100.00%
	ACTIVO NETO			9,178,281,014	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.03%

Var Promedio: 0.0003%

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			51,614,371	78.57%
1	AC	*	Alta	1,199,292	1.83%
1	ALFA	A	Alta	2,466,540	3.76%
1	ALPEK	A	Alta	1,971,600	3.00%
1	AMX	B	Alta	9,361,000	14.25%
1	CEMEX	CPO	Alta	8,004,150	12.18%
1	CTAXTEL	A	Media	160,740	0.25%
1	FEMSA	UBD	Alta	9,273,810	14.12%
1	KOF	UBL	Alta	2,696,799	4.11%
1	LASITE	B-1	Media	829,500	1.26%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	5,734,215	8.73%
1	NEMAK	A	Media	4,254,635	6.48%
1	ORBIA	*	Alta	639,100	0.97%
1	WALMEX	*	Alta	5,022,990	7.65%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			2,593,800	3.95%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	2,593,800	3.95%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			691,083	1.05%
1ISP	EWV	*	Alta	691,083	1.05%
	Reportos			10,792,351	16.43%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	10,792,351	16.43%
	TOTAL CARTERA			65,691,605	100.00%
	ACTIVO NETO			65,685,250	

Cartera al: 09/05/2024
Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.1510%

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 Cotizadas en el SIC (Spot)				4,445,725	2.08%
1ASP	BABA	N	Alta	4,003,020	1.88%
1ASP	SAN	N	Alta	442,705	0.21%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				200,278,674	93.79%
1ISP	EEM	*	Alta	20,653,051	9.67%
1ISP	EUFN	*	Alta	13,043,148	6.11%
1ISP	EWC	*	Alta	2,057,026	0.96%
1ISP	EWG	*	Alta	6,056,671	2.84%
1ISP	EWI	*	Alta	6,998,988	3.28%
1ISP	EWJ	*	Alta	17,214,094	8.06%
1ISP	EWP	*	Alta	5,090,290	2.38%
1ISP	EZU	*	Alta	21,076,308	9.87%
1ISP	FXI	*	Alta	7,821,993	3.66%
1ISP	GLD	*	Alta	3,643,155	1.71%
1ISP	HEDJ	*	Alta	11,832,536	5.54%
1ISP	IVV	*	Alta	34,668,440	16.24%
1ISP	MCHI	*	Alta	6,558,232	3.07%
1ISP	QQQ	*	Alta	11,849,396	5.55%
1ISP	SHV	*	Alta	9,806,996	4.59%
1ISP	XLE	*	Alta	2,614,230	1.22%
1ISP	XLF	*	Alta	15,814,297	7.41%
1ISP	XLI	*	Alta	3,479,821	1.63%
Reportos				8,821,685	4.13%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	8,821,685	4.13%
TOTAL CARTERA				213,546,083	100.00%
ACTIVO NETO				213,021,061	
Cartera al:		09/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.2990%

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				30,807,477	7.10%
94	BANORTE	23-4	mxAAA	10,047,250	2.32%
94	BLADEX	21	AAA (mex)	10,715,625	2.47%
94	SCOTIAB	23	AAA (mex)	10,044,601	2.32%
Certificados Bursátiles Corporativos				153,841,778	35.46%
91	AC	24	AAA (mex)	6,039,696	1.39%
91	AMX	22	AAA (mex)	10,081,112	2.32%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,083,080	3.48%
91	BACHOCO	22	AAA (mex)	10,088,044	2.33%
91	CEMEX	23L	AA (mex)	6,068,138	1.40%
91	ECREDCB	22	mxAAA	10,092,193	2.33%
91	FEMSA	22L	AAA (mex)	10,031,488	2.31%
91	GAP	24L	mxAAA	6,044,009	1.39%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	10,074,424	2.32%
91	GPH	22	AAA (mex)	10,039,713	2.31%
91	GRUMA	22	mxAA+	10,053,702	2.32%
91	KIMBER	22-2	AAA (mex)	10,001,254	2.31%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,074,749	3.47%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,017,356	3.46%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	10,052,818	2.32%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				22,885,075	5.27%
93	AMX	03524	F1+ (mex)	5,911,879	1.36%
93	GCARSO	00324	F1+ (mex)	6,047,691	1.39%
93	GMFIN	02624	F1+ (mex)	5,923,870	1.37%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
93	TOYOTA	03524	F1+ (mex)	5,001,634	1.15%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				56,598,594	13.04%
1ISP	FRMXNX	N	NO APLICA	45,305,697	10.44%
1ISP	IB1MXX	N	NO APLICA	11,292,897	2.60%
Udibonos				26,220,667	6.04%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	26,220,667	6.04%
Certificados De La Tesorería De La Federación				28,383,350	6.54%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,565,906	2.21%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	18,817,444	4.34%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				26,227,981	6.05%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	26,227,981	6.05%
Reportos				88,935,923	20.50%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	88,935,923	20.50%
TOTAL CARTERA				433,900,845	100.00%
ACTIVO NETO				433,703,857	
Cartera al:		09/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.0581%
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			78,310,723	49.26%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	32,104,427	20.19%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	35,230,879	22.16%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,975,417	6.90%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			28,227,945	17.75%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,565,906	6.02%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	9,408,722	5.92%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	9,253,317	5.82%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			7,025,352	4.42%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	7,025,352	4.42%
	Reportos			45,426,589	28.57%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	45,426,589	28.57%
	TOTAL CARTERA			158,990,609	100.00%
	ACTIVO NETO			159,062,936	
	Cartera al:	09/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.2040%

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	%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				69,645,946	0.82%
93	AMX	01624	F1+ (mex)	9,981,596	0.12%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	9,938,776	0.12%
93	AMX	03524	F1+ (mex)	9,853,132	0.12%
93	GCARSO	00324	F1+ (mex)	10,079,485	0.12%
93	GMFIN	02024	F1+ (mex)	9,916,572	0.12%
93	GMFIN	02624	F1+ (mex)	9,873,117	0.12%
93	TOYOTA	03524	F1+ (mex)	10,003,268	0.12%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				1,156,334,918	13.62%
51	+TASA	FF	AAA/1(mex)	1,156,334,918	13.62%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,170,511,011	13.79%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	397,568,200	4.68%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	39,682,557	0.47%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	97,704,560	1.15%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	97,288,180	1.15%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,659,060	1.13%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	95,262,290	1.12%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	94,864,720	1.12%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	159,948,274	1.88%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	92,533,170	1.09%
Reportos				6,094,200,985	71.78%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	2,565,057,709	30.21%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	592,520,696	6.98%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	203,632,254	2.40%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	2,336,439,468	27.52%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	396,550,857	4.67%
TOTAL CARTERA				8,490,692,860	100.00%
ACTIVO NETO				8,487,843,132	
Cartera al:		09/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0000%

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)				1,550,061,761	23.21%
FSP	BACMEXT	D24003	F1+ (mex)	143,010,675	2.14%
FSP	BACMEXT	D24004	F1+ (mex)	142,147,370	2.13%
FSP	NAFIN	D24020	F1+ (mex)	143,056,827	2.14%
FSP	NAFIN	D24023	F1+ (mex)	142,754,154	2.14%
FSP	NAFIN	D24025	F1+ (mex)	142,672,572	2.14%
FSP	NAFIN	D24027	F1+ (mex)	142,536,498	2.13%
FSP	NAFIN	D24029	F1+ (mex)	142,435,551	2.13%
FSP	NAFIN	D24031	F1+ (mex)	142,276,824	2.13%
FSP	NAFIN	D24033	F1+ (mex)	265,982,373	3.98%
FSP	NAFIN	D24034	F1+ (mex)	143,188,915	2.14%
Track de Deuda Corporativa				27,043,500	0.41%
1C	DLRTRAC	15	N/A	27,043,500	0.41%
Chequera Dolares				4,165,974,887	62.39%
CHD	37-006	4006562	N/A	1,350,896,037	20.23%
CHD	37-135	6009236	N/A	1,351,155,157	20.23%
CHD	40-002	9409199	N/A	251,889	0.00%
CHD	40-012	6539459	N/A	675,101,545	10.11%
CHD	40-044	0941285	N/A	788,570,259	11.81%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				934,779,390	14.00%
1ISP	IB01	N	N/A	934,779,390	14.00%
TOTAL CARTERA				6,677,859,539	100.00%
ACTIVO NETO				6,673,822,127	

Cartera al: 09/05/2024
Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 0.9743%
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