

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			10,130,043,712	100.00%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	873,074,269	8.62%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	429,840,328	4.24%
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	254,453,837	2.51%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	306,652,133	3.03%
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	1,329,269,100	13.12%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	366,379,749	3.62%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	527,051,253	5.20%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	2,623,046,704	25.89%
IS	BPA182	290322	AAA(mex)	841,700,806	8.31%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	1,678,294,586	16.57%
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	900,280,947	8.89%
	TOTAL CARTERA			10,130,043,712	100.00%
	ACTIVO NETO			10,121,744,561	

Cartera al: 19/10/2023
Límite Máximo de VaR: 0.03%
Var Promedio: 0.0005%

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			54,747,750	84.60%
1	AC	*	Alta	1,112,400	1.72%
1	ALFA	A	Alta	2,168,000	3.35%
1	ALPEK	A	Alta	2,238,975	3.46%
1	AMX	B	Alta	11,151,800	17.23%
1	CEMEX	CPO	Alta	8,018,500	12.39%
1	CTAXTEL	A	Media	93,480	0.14%
1	FEMSA	UBD	Alta	10,968,100	16.95%
1	KOF	UBL	Alta	2,128,720	3.29%
1	LASITE	B-1	Media	1,106,895	1.71%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	5,117,500	7.91%
1	NEMAK	A	Media	4,893,100	7.56%
1	ORBIA	*	Alta	827,310	1.28%
1	PE&OLES	*	Alta	922,995	1.43%
1	WALMEX	*	Alta	3,999,975	6.18%
	Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Acciones			4,078,975	6.30%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	4,078,975	6.30%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			2,456,992	3.80%
1ISP	EWV	*	Alta	2,456,992	3.80%
	Reportos			3,430,618	5.30%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	3,430,618	5.30%
	TOTAL CARTERA			64,714,335	100.00%
	ACTIVO NETO			64,248,799	

Cartera al: 19/10/2023
Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.4371%

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			323,742	0.15%
1E	SAN	*	Baja	323,742	0.15%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			5,374,939	2.43%
1ASP	BABA	N	Alta	5,374,939	2.43%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			211,141,108	95.61%
1ISP	EEM	*	Alta	23,981,702	10.86%
1ISP	EUFN	*	Alta	13,618,302	6.17%
1ISP	EWC	*	Alta	2,285,130	1.04%
1ISP	EWG	*	Alta	6,427,841	2.91%
1ISP	EWI	*	Alta	7,125,148	3.23%
1ISP	EWJ	*	Alta	19,378,072	8.77%
1ISP	EWP	*	Alta	5,546,599	2.51%
1ISP	EZU	*	Alta	21,956,102	9.94%
1ISP	FXI	*	Alta	6,920,703	3.13%
1ISP	GLD	*	Alta	3,684,554	1.67%
1ISP	HEDJ	*	Alta	12,460,515	5.64%
1ISP	IVV	*	Alta	40,362,143	18.28%
1ISP	MCHI	*	Alta	10,520,352	4.76%
1ISP	QQQ	*	Alta	12,644,312	5.73%
1ISP	SHV	*	Alta	1,009,324	0.46%
1ISP	XLE	*	Alta	3,358,925	1.52%
1ISP	XLF	*	Alta	16,212,303	7.34%
1ISP	XLI	*	Alta	3,649,081	1.65%
	Reportos			4,006,764	1.81%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	4,006,764	1.81%
	TOTAL CARTERA			220,846,554	100.00%
	ACTIVO NETO			219,726,437	
	Cartera al:		19/10/2023		

Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.6040%

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				30,838,911	6.20%
94	BANORTE	23-4	mxAAA	10,025,689	2.02%
94	BLADEX	21	AAA (mex)	10,789,935	2.17%
94	SCOTIAB	23	AAA (mex)	10,023,287	2.01%
Certificados Bursátiles Corporativos				160,533,526	32.26%
91	AMX	22	AAA (mex)	10,056,573	2.02%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,141,320	3.04%
91	BACHOCO	22	AAA (mex)	10,067,403	2.02%
91	ECREDCB	22	mxAAA	10,015,185	2.01%
91	FEMSA	22L	AAA (mex)	10,009,578	2.01%
91	GAP	19	mxAAA	15,085,286	3.03%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	10,057,484	2.02%
91	GPH	22	AAA (mex)	10,018,311	2.01%
91	GRUMA	22	mxAA+	10,032,444	2.02%
91	KIMBER	22-2	AAA (mex)	10,067,935	2.02%
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	9,807,652	1.97%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,037,930	3.02%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,108,230	3.04%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	10,028,196	2.02%
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)				44,114,149	8.87%
1ISP	FRMXNX	N	Alta	33,493,500	6.73%
1ISP	IB1MXX	N	Alta	10,620,649	2.13%
Udibonos				24,967,590	5.02%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	24,967,590	5.02%
Certificados De La Tesorería De La Federación				39,382,539	7.91%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	8,983,763	1.81%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	17,673,700	3.55%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	12,725,076	2.56%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				37,688,104	7.57%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	12,299,855	2.47%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	25,388,249	5.10%
Reportos				160,112,826	32.18%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	160,112,826	32.18%
TOTAL CARTERA				497,637,644	100.00%
ACTIVO NETO				497,350,782	
Cartera al:		19/10/2023			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.0675%
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			75,209,971	41.22%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	31,107,053	17.05%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	33,547,206	18.38%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,555,712	5.79%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			36,565,366	20.04%
BI	CETES	231116	AAA(mex)	4,958,698	2.72%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	8,983,763	4.92%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	8,836,850	4.84%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	8,696,025	4.77%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	5,090,030	2.79%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			19,100,279	10.47%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	12,299,855	6.74%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	6,800,424	3.73%
	Reportos			51,603,587	28.28%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	51,603,587	28.28%
	TOTAL CARTERA			182,479,203	100.00%
	ACTIVO NETO			181,019,695	
	Cartera al:	19/10/2023			

Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.2310%

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			780,975,934	7.43%
51	+TASA	FF	AAA/1(mex)	780,975,934	7.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,594,469,454	15.17%
BI	CETES	231101	AAA(mex)	199,256,120	1.90%
BI	CETES	231116	AAA(mex)	193,389,222	1.84%
BI	CETES	231130	AAA(mex)	168,084,387	1.60%
BI	CETES	231214	AAA(mex)	442,440,990	4.21%
BI	CETES	231228	AAA(mex)	244,703,825	2.33%
BI	CETES	240404	AAA(mex)	284,736,960	2.71%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	61,857,950	0.59%
	Reportos			8,138,784,971	77.41%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	3,962,567,689	37.69%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	2,411,969,069	22.94%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	636,445,458	6.05%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	1,127,802,754	10.73%
	TOTAL CARTERA			10,514,230,359	100.00%
	ACTIVO NETO			10,508,575,509	
	Cartera al:	19/10/2023			

Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0025%

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)				1,638,749,995	28.13%
FSP	BACMEXT	D23008	F1+ (mex)	150,250,010	2.58%
FSP	BACMEXT	D23009	F1+ (mex)	151,161,475	2.60%
FSP	NAFIN	D23063	F1+ (mex)	151,353,522	2.60%
FSP	NAFIN	D23065	F1+ (mex)	151,221,143	2.60%
FSP	NAFIN	D23068	F1+ (mex)	150,907,693	2.59%
FSP	NAFIN	D23070	F1+ (mex)	150,820,192	2.59%
FSP	NAFIN	D23072	F1+ (mex)	150,672,856	2.59%
FSP	NAFIN	D23074	F1+ (mex)	150,570,290	2.58%
FSP	NAFIN	D23075	F1+ (mex)	281,397,965	4.83%
FSP	NAFIN	D23076	F1+ (mex)	150,394,849	2.58%
Track de Deuda Corporativa				43,757,500	0.75%
1C	DLRTRAC	15	NO APLICA	43,757,500	0.75%
Chequera Dolares				3,624,649,271	62.21%
CHD	37-006	4006562	N/A	889,933,620	15.28%
CHD	37-135	6009236	N/A	1,244,734,783	21.36%
CHD	40-002	9409199	N/A	274,422	0.01%
CHD	40-012	6539459	N/A	740,271,328	12.71%
CHD	40-044	0941285	N/A	749,435,119	12.86%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				519,055,610	8.91%
1ISP	IB01	N	NO APLICA	519,055,610	8.91%
TOTAL CARTERA				5,826,212,376	100.00%
ACTIVO NETO				5,823,411,767	

Cartera al: 19/10/2023
Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.0300%
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