

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			8,765,143,152	100.00%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	877,455,698	10.01%
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	500,863,457	5.71%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	779,547,348	8.89%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	552,536,119	6.30%
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	901,387,439	10.28%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	269,815,079	3.08%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	3,126,354,130	35.67%
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	955,955,021	10.91%
LD	BONDESD	260806	AAA(mex)	801,228,860	9.14%
	TOTAL CARTERA			8,765,143,152	100.00%
	ACTIVO NETO			8,752,043,171	

Cartera al: 27/Mzo/2024
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			55,325,205	83.20%
1	AC	*	Alta	1,261,078	1.90%
1	ALFA	A	Alta	2,387,410	3.59%
1	ALPEK	A	Alta	1,904,950	2.87%
1	AMX	B	Alta	10,165,950	15.29%
1	CEMEX	CPO	Alta	8,875,350	13.35%
1	CTAXTEL	A	Media	96,140	0.15%
1	FEMSA	UBD	Alta	8,841,240	13.30%
1	KOF	UBL	Alta	2,550,042	3.84%
1	LASITE	B-1	Media	894,280	1.35%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	7,635,920	11.48%
1	NEMAK	A	Media	4,650,415	6.99%
1	ORBIA	*	Alta	764,060	1.15%
1	PE&OLES	*	Alta	1,010,371	1.52%
1	WALMEX	*	Alta	4,288,000	6.45%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			2,567,250	3.86%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	2,567,250	3.86%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			686,483	1.03%
1ISP	EWV	*	Alta	686,483	1.03%
	Reportos			7,915,053	11.90%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	7,915,053	11.90%
	TOTAL CARTERA			66,493,991	100.00%
	ACTIVO NETO			66,305,854	

Cartera al: 27/Mzo/2024
Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.2581%
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)				3,970,626	1.87%
1ASP	BABA	N	Alta	3,557,128	1.68%
1ASP	SAN	N	Alta	413,498	0.20%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				195,698,417	92.33%
1ISP	EEM	*	Alta	19,659,191	9.28%
1ISP	EUFN	*	Alta	12,545,017	5.92%
1ISP	EWC	*	Alta	2,017,710	0.95%
1ISP	EWG	*	Alta	5,938,277	2.80%
1ISP	EWI	*	Alta	6,914,016	3.26%
1ISP	EWJ	*	Alta	17,790,609	8.39%
1ISP	EWP	*	Alta	5,011,249	2.36%
1ISP	EZU	*	Alta	20,642,622	9.74%
1ISP	FXI	*	Alta	6,704,003	3.16%
1ISP	GLD	*	Alta	3,363,844	1.59%
1ISP	HEDJ	*	Alta	11,859,148	5.60%
1ISP	IVV	*	Alta	34,393,588	16.23%
1ISP	MCHI	*	Alta	5,694,585	2.69%
1ISP	QQQ	*	Alta	11,787,995	5.56%
1ISP	SHV	*	Alta	9,702,462	4.58%
1ISP	XLE	*	Alta	2,552,447	1.20%
1ISP	XLF	*	Alta	15,679,951	7.40%
1ISP	XLI	*	Alta	3,441,704	1.62%
Reportos				12,279,699	5.79%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	12,279,699	5.79%
TOTAL CARTERA				211,948,742	100.00%
ACTIVO NETO				210,825,998	
Cartera al:		27/Mzo/2024			

Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.3913%

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				30,977,092	6.71%
94	BANORTE	23-4	mxAAA	10,102,756	2.19%
94	BLADDEX	21	AAA (mex)	10,774,223	2.33%
94	SCOTIAB	23	AAA (mex)	10,100,113	2.19%
Certificados Bursátiles Corporativos				154,042,166	33.38%
91	AC	24	AAA (mex)	6,019,938	1.30%
91	AMX	22	AAA (mex)	10,043,328	2.18%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,041,829	3.26%
91	BACHOCO	22	AAA (mex)	10,055,073	2.18%
91	CEMEX	23L	AA (mex)	6,022,454	1.31%
91	ECREDCB	22	mxAAA	10,068,372	2.18%
91	FEMSA	22L	AAA (mex)	10,086,977	2.19%
91	GAP	24L	mxAAA	6,024,013	1.31%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	10,037,429	2.18%
91	GPH	22	AAA (mex)	10,096,203	2.19%
91	GRUMA	22	mxAA+	10,110,675	2.19%
91	KIMBER	22-2	AAA (mex)	10,056,242	2.18%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,168,997	3.29%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,100,200	3.27%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	10,110,436	2.19%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				17,856,175	3.87%
93	AMX	01224	F1+ (mex)	5,981,716	1.30%
93	GCARSO	00324	F1+ (mex)	6,023,853	1.31%
93	GMFIN	02624	F1+ (mex)	5,850,605	1.27%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				55,855,995	12.10%
1ISP	FRMXNX	N	Alta	44,693,305	9.68%
1ISP	IB1MXX	N	Alta	11,162,690	2.42%
Udibonos				26,214,001	5.68%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	26,214,001	5.68%
Certificados De La Tesorería De La Federación				41,477,253	8.99%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,456,687	2.05%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	18,616,402	4.03%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	13,404,164	2.90%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				26,494,232	5.74%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	26,494,232	5.74%
Reportos				108,630,204	23.54%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	108,630,204	23.54%
TOTAL CARTERA				461,547,117	100.00%
ACTIVO NETO				461,260,046	
Cartera al:		27/Mzo/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.57%

Var Promedio: 0.0552%

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			78,127,353	47.60%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	31,908,564	19.44%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	35,221,923	21.46%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,996,866	6.70%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			33,291,237	20.29%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,456,687	5.76%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	9,308,201	5.67%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	9,164,684	5.58%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	5,361,665	3.27%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			7,096,669	4.32%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	7,096,669	4.32%
	Reportos			45,604,043	27.79%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	45,604,043	27.79%
	TOTAL CARTERA			164,119,302	100.00%
	ACTIVO NETO			163,567,230	

Cartera al: 27/Mzo/2024
Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.2060%

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				49,264,949	0.76%
93	AMX	01624	F1+ (mex)	9,861,524	0.15%
93	AMX	02224	F1+ (mex)	9,817,754	0.15%
93	GCARSO	00324	F1+ (mex)	10,039,756	0.16%
93	GMFIN	02024	F1+ (mex)	9,794,906	0.15%
93	GMFIN	02624	F1+ (mex)	9,751,009	0.15%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				1,048,411,201	16.24%
51	+TASA	FF	AAA/1(mex)	1,048,411,201	16.24%
Certificados De La Tesorería De La Federación				945,768,144	14.65%
BI	CETES	240404	AAA(mex)	299,722,230	4.64%
BI	CETES	240418	AAA(mex)	49,740,180	0.77%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	99,060,490	1.53%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	392,874,840	6.09%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	39,212,997	0.61%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	65,157,407	1.01%
Reportos				4,413,472,046	68.35%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	2,964,249,739	45.91%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	607,629,553	9.41%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	841,592,754	13.03%
TOTAL CARTERA				6,456,916,339	100.00%
ACTIVO NETO				6,451,013,152	

Cartera al: 27/Mzo/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)				1,520,040,137	23.36%
FSP	BACMEXT	D24002	F1+ (mex)	139,390,011	2.14%
FSP	BACMEXT	D24003	F1+ (mex)	140,239,637	2.16%
FSP	NAFIN	D24009	F1+ (mex)	139,906,812	2.15%
FSP	NAFIN	D24011	F1+ (mex)	139,771,386	2.15%
FSP	NAFIN	D24013	F1+ (mex)	139,671,793	2.15%
FSP	NAFIN	D24015	F1+ (mex)	139,515,704	2.14%
FSP	NAFIN	D24018	F1+ (mex)	140,411,597	2.16%
FSP	NAFIN	D24020	F1+ (mex)	140,279,658	2.16%
FSP	NAFIN	D24022	F1+ (mex)	260,867,765	4.01%
FSP	NAFIN	D24023	F1+ (mex)	139,985,773	2.15%
Track de Deuda Corporativa				26,553,450	0.41%
1C	DLRTRAC	15	N/A	26,553,450	0.41%
Chequera Dolares				4,106,367,760	63.11%
CHD	37-006	4006562	N/A	1,325,002,211	20.37%
CHD	37-135	6009236	N/A	1,325,198,930	20.37%
CHD	40-002	9409199	N/A	248,438	0.00%
CHD	40-012	6539459	N/A	681,804,007	10.48%
CHD	40-044	0941285	N/A	774,114,175	11.90%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				853,323,188	13.12%
1ISP	IB01	N	N/A	853,323,188	13.12%
TOTAL CARTERA				6,506,284,534	100.00%
ACTIVO NETO				6,501,064,326	

Cartera al: 27/Mzo/2024
Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 0.9820%
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