

**MEDIANO PLAZO**

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			193,219,012	5.08%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	193,219,012	5.08%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			90,251,695	2.37%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	90,251,695	2.37%
	Certificados Bursátiles Bancarios			185,763,452	4.88%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,058,606	1.63%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,342,011	1.56%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,874,695	0.92%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,488,140	0.78%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,194,621,946	57.64%
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	191,291,620	5.03%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,296,648	3.95%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,236,885	3.24%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,207,060	3.16%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,976,934	2.65%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,909,304	2.65%
91	ARA	23X	mxAA-	100,786,562	2.65%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,501,291	2.64%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	100,436,373	2.64%
91	DONDE	23	HR AA	100,118,351	2.63%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,046,607	2.63%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	91,494,727	2.40%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,288,970	2.37%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,011,933	2.10%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,490,994	1.98%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,302,393	1.98%
91	TPLAY	22	HR A	75,074,019	1.97%
91	SALUD	20	HR A+	74,583,893	1.96%
91	SALUD	21	HR A+	50,453,812	1.33%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,225,068	1.06%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,193,110	1.06%

91	BEGRAND	23	A+/M	40,043,946	1.05%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	37,303,979	0.98%
91	TPLAYCB	20	HR AA	37,211,643	0.98%
91	GASA	24	HR AA+	20,196,587	0.53%
91	HYCSA	24	HR AA	20,162,406	0.53%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,091,114	0.53%
91	FUTILCB	24S	mxAAA	20,040,115	0.53%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,645,603	0.46%

Certificados De La Tesorería De La Federación	551,574,113	14.49%
--	--------------------	---------------

BI	CETES	251224	AAA(mex)	291,297,923	7.65%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	151,491,440	3.98%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	108,784,750	2.86%

Chequera Dolares	190,981	0.01%
-------------------------	----------------	--------------

CHD	40-133	8355257		190,981	0.01%
-----	--------	---------	--	---------	-------

Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial	105,808,770	2.78%
--	--------------------	--------------

93	ELEKTRA	00124	HR1	100,795,979	2.65%
93	AUTLAN	00224	F2 (mex)	5,012,791	0.13%

Swaps Entregables	-10,468,100	-0.28%
--------------------------	--------------------	---------------

SWP	2TIEMXP	260218		-43,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	261005		-8,730,800	-0.23%
SWP	2TIEMXP	261006		-1,941,500	-0.05%
SWP	2TIEMXP	261015		-177,300	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250207		424,500	0.01%

Títulos de Organismos Financieros Multilaterales	124,701,615	3.28%
---	--------------------	--------------

JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,701,615	3.28%
----	-------	-------	-------	-------------	-------

Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal	90,799,557	2.39%
--	-------------------	--------------

95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,799,557	2.39%
----	-----	-------	-----------	------------	-------

Reportos	280,710,383	7.37%
-----------------	--------------------	--------------

IS	BPA182	280412	AAA(mex)	202,661,094	5.32%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	78,049,289	2.05%

TOTAL CARTERA	3,807,173,424	100.00%
----------------------	----------------------	----------------

ACTIVO NETO	3,831,661,746
--------------------	----------------------

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.139 %

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."