

MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			10,047,607,230	17.90%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	3,482,611,064	6.20%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	3,227,803,555	5.75%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,010,910,690	3.58%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	496,865,605	0.89%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	485,164,845	0.86%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	344,251,471	0.61%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			671,814,633	1.20%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	671,814,633	1.20%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,477,686,766	2.63%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	835,865,534	1.49%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	566,673,698	1.01%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,147,535	0.13%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,108,396,370	3.76%
94	BACTIN	22	AA (mex)	451,634,463	0.80%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	404,919,248	0.72%
94	BACTIN	23	AA (mex)	402,019,628	0.72%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,841,533	0.64%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,929,019	0.46%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,052,479	0.41%
	Certificados Bursátiles Corporativos			5,588,128,555	9.95%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	400,186,428	0.71%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	400,059,664	0.71%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,698,235	0.65%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,735,179	0.63%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	319,021,028	0.57%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	302,094,996	0.54%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	264,723,173	0.47%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	251,636,648	0.45%
91	TPLAYCB	24	HR AA	251,423,823	0.45%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	246,473,770	0.44%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	213,302,651	0.38%
91	NM	24	mxAA+	204,251,523	0.36%
91	GAP	24	mxAAA	200,942,792	0.36%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	183,056,618	0.33%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,030,586	0.28%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,363,956	0.27%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	150,091,964	0.27%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	147,540,510	0.26%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	143,236,140	0.26%
91	FINN	18	A- (mex)	114,673,122	0.20%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,976,934	0.18%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,193,013	0.17%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	88,279,868	0.16%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,024,661	0.16%
91	LAB	23	AA (mex)	85,410,256	0.15%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	81,328,646	0.15%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	53,870,629	0.10%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,281,336	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	41,673,648	0.07%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	35,763,954	0.06%
91	AERMXCB	19	AA+/M	22,611,907	0.04%
91	GAP	21V	mxAAA	15,031,884	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,139,015	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

23,811,840,024

42.41%

BI	CETES	250821	AAA(mex)	3,562,164,437	6.34%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,790,619,297	4.97%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	2,501,541,878	4.46%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	2,166,775,836	3.86%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,878,440,692	3.35%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,765,152,900	3.14%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	1,756,967,448	3.13%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,494,134,267	2.66%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,442,359,650	2.57%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,060,005,535	1.89%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	915,760,945	1.63%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	906,158,110	1.61%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	628,699,455	1.12%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	476,862,174	0.85%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	466,197,400	0.83%

Chequera Euros

60,832

0.00%

CHE	40-012	5500702		60,832	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

Chequera Dolares

14,090,170

0.03%

CHD	40-133	8035859		14,090,170	0.03%
-----	--------	---------	--	------------	-------

	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			606,698,065	1.08%
D8	CAF0627	90	AA-	405,894,548	0.72%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,803,517	0.36%
	Titulos de Credito Extranjeros			663,242,280	1.18%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	357,542,247	0.64%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	169,585,920	0.30%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	136,114,113	0.24%
	Eurobonos de Empresas Privadas			353,841,713	0.63%
D2	CAF872	310222	AA-	253,637,060	0.45%
D2	KEXIM	250426	AA	100,204,653	0.18%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			15,107,331	0.03%
93	MINSA	00124	HR2	15,107,331	0.03%
	Swaps Entregables			1,126,750	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		636,750	0.00%
SWP	2TIEMXP	250403		490,000	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			601,465,875	1.07%
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	500,572,805	0.89%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,893,070	0.18%
	Udibonos			2,543,850,703	4.53%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	2,543,850,703	4.53%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,311,578,309	2.34%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	423,731,267	0.76%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	361,700,845	0.64%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,153,133	0.45%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,380,790	0.21%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,165,441	0.14%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	74,446,833	0.13%
	Reportos			652,862,018	1.16%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	228,266,519	0.41%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	137,127,335	0.24%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	114,553,359	0.20%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	87,397,846	0.16%
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	50,014,542	0.09%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	22,871,126	0.04%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	12,631,291	0.02%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			5,678,457,097	10.11%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,398,811,358	2.49%

LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	1,071,892,028	1.91%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	1,003,062,570	1.79%
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	998,929,620	1.78%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	703,950,086	1.25%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	501,811,435	0.89%
TOTAL CARTERA				56,147,854,721	100.00%
ACTIVO NETO				56,178,325,359	

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.061 %
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."