

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			993,753,502	10.13%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	291,098,907	2.97%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	245,124,691	2.50%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	192,131,164	1.96%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	147,536,345	1.50%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	64,097,452	0.65%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	53,764,943	0.55%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			227,423,102	2.32%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	227,423,102	2.32%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			600,514,738	6.12%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	600,514,738	6.12%
	Certificados Bursátiles Bancarios			70,683,689	0.72%
94	COMPART	20	AA (mex)	70,683,689	0.72%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,728,164,859	27.81%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	195,828,168	2.00%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	191,755,073	1.96%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,412,714	1.89%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,902,324	1.84%
91	GICSA	19	B/M	174,064,358	1.77%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	170,969,685	1.74%
91	AERMXCB	19	AA+/M	165,214,424	1.68%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	160,714,186	1.64%
91	TPLAYCB	24	HR AA	150,854,294	1.54%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	144,391,806	1.47%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	118,887,653	1.21%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,654,659	1.03%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	93,666,574	0.96%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	87,739,614	0.89%
91	CADU	20V	A/M	73,657,638	0.75%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	68,744,702	0.70%

91	LAMOSA	19	AA (mex)	66,175,953	0.68%
91	IDEI	23+V	HR BBB	48,370,036	0.49%
91	TPLAYCB	20	HR AA	44,638,343	0.46%
91	GHEMA	23	HR BBB+	43,165,534	0.44%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,069,087	0.41%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	35,021,458	0.36%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	34,367,405	0.35%
91	GICSA	17	B/M	23,712,264	0.24%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	22,495,523	0.23%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,639,992	0.22%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	20,209,585	0.21%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,021,973	0.20%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,658,431	0.17%
91	AMX	22	AAA (mex)	11,883,895	0.12%
91	VINTE	17-2	HR AA-	10,019,948	0.10%
91	BRX	22	AA (mex)	4,055,089	0.04%
91	GICSA	15	B/M	2,202,473	0.02%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			920,127,345	9.38%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	508,038,780	5.18%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	277,643,370	2.83%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	134,445,195	1.37%
	Chequera Euros			91,265	0.00%
CHE	40-012	5514622		91,265	0.00%
	Chequera Dolares			1,275,107	0.01%
CHD	40-133	8030298		1,275,107	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			194,985,996	1.99%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	194,985,996	1.99%
	Eurobonos de Empresas Privadas			422,728,434	4.31%
D2	CAF872	310222	AA-	422,728,434	4.31%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			72,756,132	0.74%
93	AMX	13024	F1+ (mex)	72,756,132	0.74%
	Swaps Entregables			245,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250403		245,000	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			95,529,897	0.97%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,529,897	0.97%
	Udibonos			957,216,913	9.76%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	957,216,913	9.76%

	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,449,048,822	14.77%
95	PEMEX	19	mxAAA	665,684,270	6.79%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	474,475,662	4.84%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	308,888,891	3.15%
	Reportos			1,074,948,991	10.96%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	300,087,698	3.06%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	283,082,532	2.89%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	277,008,095	2.82%
IS	BPA182	280928	AAA(mex)	214,770,667	2.19%
	TOTAL CARTERA			9,809,493,792	100.00%
	ACTIVO NETO			9,832,549,354	

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.161 %
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."