

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AA/7CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				342,431,551	21.31%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	163,302,055	10.16%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	81,010,289	5.04%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	51,121,736	3.18%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,506,045	2.02%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,491,426	0.90%
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				45,265,684	2.82%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,240,983	1.63%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,362,109	0.89%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,662,593	0.29%
Certificados Bursátiles Corporativos				497,996,242	30.98%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	43,821,037	2.73%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,234,467	1.76%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,842,385	1.61%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	24,878,491	1.55%
91	OSM	15U	mxAA-	23,579,782	1.47%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,648,197	1.35%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,573,570	1.34%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,110,885	1.31%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,479,120	1.27%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,908,388	1.24%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,499,302	1.21%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,077,629	1.19%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,861,018	1.17%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,845,966	1.17%
91	SALUD	21	HR A+	18,017,538	1.12%
91	SALUD	20	HR A+	16,743,323	1.04%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,484,348	1.03%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,337,857	0.95%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,062,491	0.88%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,812,740	0.80%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,852,009	0.74%

91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,978,257	0.56%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,321,632	0.46%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,063,651	0.44%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,570,926	0.41%
91	GHEMA	23	HR BBB+	6,024,303	0.38%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,306,312	0.33%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,973,216	0.31%
91	NM	15	mxAA+	4,038,274	0.25%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,149,467	0.20%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,935,680	0.18%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,585,234	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,809,074	0.11%
91	GHOCB	14	HR D	1,401,278	0.09%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,298,213	0.08%
91	OSM	15	mxAA-	751,917	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	634,686	0.04%
91	DMXI	15	mxD	481,668	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,915	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			91,939,066	5.72%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,513,900	2.71%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	33,556,968	2.09%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	14,868,198	0.93%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,697,168	0.91%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,697,168	0.91%
	Udibonos			527,815,350	32.84%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	305,936,611	19.04%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	221,878,739	13.81%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			40,741,036	2.54%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,848,461	0.74%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,142,050	0.63%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,002,901	0.44%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,190,670	0.39%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,024,617	0.25%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,532,337	0.10%
	Reportos			46,376,547	2.89%
BI	CETES	250116	AAA(mex)	46,376,547	2.89%
	TOTAL CARTERA			1,607,262,644	100.00%
	ACTIVO NETO			1,608,171,050	

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.558 %
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."
