

**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			191,497,398	5.07%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	191,497,398	5.07%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			89,868,837	2.38%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	89,868,837	2.38%
	Certificados Bursátiles Bancarios			186,069,930	4.93%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,342,083	1.65%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,082,277	1.57%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	35,026,530	0.93%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,619,040	0.79%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,194,709,670	58.14%
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	190,479,418	5.05%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,966,278	4.00%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,892,899	3.28%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,584,967	3.17%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	100,874,222	2.67%
91	DONDE	23	HR AA	100,610,388	2.67%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,473,053	2.66%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,454,912	2.66%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,420,910	2.66%
91	ARA	23X	mxAA-	100,308,278	2.66%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,076,118	2.65%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	91,047,920	2.41%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,697,056	2.40%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,351,002	2.13%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,835,052	2.01%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,689,462	2.01%
91	TPLAY	22	HR A	75,455,352	2.00%
91	SALUD	20	HR A+	74,207,146	1.97%
91	SALUD	21	HR A+	50,691,457	1.34%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,368,098	1.07%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,249,972	1.07%

91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,015,225	1.06%
91	ENGECB	24	AAA (mex)	37,091,320	0.98%
91	TPLAYCB	20	HR AA	37,025,697	0.98%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,182,591	0.54%
91	GASA	24	HR AA+	20,098,285	0.53%
91	HYCSA	24	HR AA	20,059,205	0.53%
91	FUTILCB	24S	mxAAA	19,940,789	0.53%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,562,600	0.47%
Certificados De La Tesorería De La Federación				548,101,183	14.52%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	289,263,748	7.66%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	150,820,848	4.00%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	108,016,588	2.86%
Chequera Dolares				187,108	0.01%
CHD	40-133	8355257		187,108	0.01%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				105,367,536	2.79%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,332,282	2.66%
93	AUTLAN	00224	F2 (mex)	5,035,254	0.13%
Swaps Entregables				-22,836,750	-0.61%
SWP	2TIEMXP	260218		-690,750	-0.02%
SWP	2TIEMXP	261005		-16,038,100	-0.43%
SWP	2TIEMXP	261006		-4,712,000	-0.13%
SWP	2TIEMXP	261015		-1,832,700	-0.05%
SWP	2TIEMXP	250207		353,500	0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		83,300	0.00%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				124,177,213	3.29%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,177,213	3.29%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				90,994,723	2.41%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,994,723	2.41%
Reportos				266,870,822	7.07%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	173,793,960	4.60%
BI	CETES	250130	AAA(mex)	93,076,862	2.47%
TOTAL CARTERA				3,775,007,670	100.00%
ACTIVO NETO				3,804,461,080	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.124 %

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."