

## DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>788,194,682</b>	<b>8.12%</b>
M	BONOS	290301	AAA(mex)	288,693,435	2.97%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	190,810,970	1.96%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	147,191,890	1.52%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	97,709,895	1.01%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,788,493	0.66%
	<b>Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij</b>			<b>225,311,895</b>	<b>2.32%</b>
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	225,311,895	2.32%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>597,967,286</b>	<b>6.16%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	597,967,286	6.16%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>70,256,675</b>	<b>0.72%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	70,256,675	0.72%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,716,504,141</b>	<b>27.97%</b>
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	194,048,968	2.00%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	190,442,727	1.96%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,250,738	1.92%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,137,012	1.86%
91	GICSA	19	B/M	172,244,275	1.77%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	169,595,817	1.75%
91	AERMXCB	19	AA+/M	164,438,246	1.69%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	158,679,243	1.63%
91	TPLAYCB	24	HR AA	150,056,060	1.55%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,672,356	1.48%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	119,084,465	1.23%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	101,113,403	1.04%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	92,454,075	0.95%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	87,072,862	0.90%
91	CADU	20V	A/M	73,035,041	0.75%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	71,750,823	0.74%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	65,611,990	0.68%

91	IDEI	23+V	HR BBB	48,592,943	0.50%
91	TPLAYCB	20	HR AA	44,415,286	0.46%
91	GHEMA	23	HR BBB+	42,937,086	0.44%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	39,752,967	0.41%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	35,171,945	0.36%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	34,200,140	0.35%
91	GICSA	17	B/M	23,445,251	0.24%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	22,173,978	0.23%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,445,684	0.22%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,124,986	0.21%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	20,071,135	0.21%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,519,711	0.17%
91	AMX	22	AAA (mex)	11,834,672	0.12%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,932,228	0.10%
91	BRX	22	AA (mex)	4,018,828	0.04%
91	GICSA	15	B/M	2,179,200	0.02%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>913,549,185</b>	<b>9.41%</b>
BI	CETES	260806	AAA(mex)	503,807,040	5.19%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	276,235,800	2.84%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	133,506,345	1.37%
	<b>Chequera Euros</b>			<b>92,144</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		92,144	0.00%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>1,026,776</b>	<b>0.01%</b>
CHD	40-133	8030298		1,026,776	0.01%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>194,115,147</b>	<b>2.00%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	194,115,147	2.00%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>418,409,349</b>	<b>4.31%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	418,409,349	4.31%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>72,440,118</b>	<b>0.75%</b>
93	AMX	13024	F1+ (mex)	72,440,118	0.75%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>92,200</b>	<b>0.00%</b>
SWP	2TIEMXP	250403		-62,500	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		154,700	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>95,128,170</b>	<b>0.98%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,128,170	0.98%
	<b>Udibonos</b>			<b>951,508,659</b>	<b>9.80%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	951,508,659	9.80%

	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>1,452,098,537</b>	<b>14.95%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	662,483,593	6.82%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	471,261,057	4.85%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	318,353,887	3.28%
	<b>Reportos</b>			<b>1,216,611,605</b>	<b>12.53%</b>
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	500,147,131	5.15%
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	433,381,549	4.46%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	283,082,926	2.91%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>9,713,306,569</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>9,597,597,340</b>	

**Cartera al: 31/10/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.099 %**  
**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."**