

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			9,450,850,623	16.84%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	3,260,083,013	5.81%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	2,919,407,841	5.20%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,002,603,719	3.57%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	494,470,640	0.88%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	481,155,725	0.86%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	293,129,685	0.52%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			665,578,067	1.19%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	665,578,067	1.19%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,472,069,795	2.62%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	832,319,698	1.48%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	564,288,909	1.01%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,461,188	0.13%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,102,693,242	3.75%
94	BACTIN	22	AA (mex)	449,615,678	0.80%
94	BACTIN	23	AA (mex)	403,804,220	0.72%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	403,148,384	0.72%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	360,257,785	0.64%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	254,829,570	0.45%
94	BACTIN	21	AA (mex)	231,037,606	0.41%
	Certificados Bursátiles Corporativos			5,588,226,797	9.96%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	401,892,212	0.72%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	401,755,008	0.72%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	364,170,121	0.65%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	352,255,095	0.63%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	320,462,932	0.57%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	300,815,115	0.54%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	262,151,025	0.47%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	252,783,508	0.45%
91	TPLAYCB	24	HR AA	250,093,433	0.45%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	247,785,797	0.44%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	214,232,537	0.38%
91	NM	24	mxAA+	205,144,156	0.37%
91	GAP	24	mxAAA	200,063,986	0.36%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,144,516	0.33%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,739,129	0.29%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	150,736,905	0.27%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	150,682,368	0.27%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	145,630,621	0.26%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	141,950,004	0.25%
91	FINN	18	A- (mex)	113,746,771	0.20%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,420,910	0.18%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,670,409	0.17%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	87,906,417	0.16%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,403,537	0.16%
91	LAB	23	AA (mex)	85,788,438	0.15%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	80,931,484	0.14%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	56,226,326	0.10%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,019,032	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	41,337,037	0.07%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	35,589,892	0.06%
91	AERMXCB	19	AA+/M	22,505,676	0.04%
91	GAP	21V	mxAAA	15,096,154	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,096,246	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

24,172,727,167

43.08%

BI	CETES	250821	AAA(mex)	3,544,105,314	6.32%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,778,081,822	4.95%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	2,483,877,723	4.43%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	2,360,364,462	4.21%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	2,156,462,318	3.84%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,757,415,420	3.13%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	1,742,332,680	3.11%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,483,700,514	2.64%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,435,681,650	2.56%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,053,778,540	1.88%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	911,707,238	1.63%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	901,989,872	1.61%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	625,860,712	1.12%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	473,522,652	0.84%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	463,846,250	0.83%

Chequera Euros

61,418

0.00%

CHE	40-012	5500702		61,418	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

Chequera Dolares

3,796,114

0.01%

CHD	40-133	8035859		3,796,114	0.01%
-----	--------	---------	--	-----------	-------

	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			604,939,779	1.08%
D8	CAF0627	90	AA-	403,223,776	0.72%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	201,716,002	0.36%
	Titulos de Credito Extranjeros			657,395,134	1.17%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	354,831,923	0.63%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	167,763,503	0.30%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	134,799,708	0.24%
	Eurobonos de Empresas Privadas			350,721,465	0.63%
D2	CAF872	310222	AA-	251,045,610	0.45%
D2	KEXIM	250426	AA	99,675,856	0.18%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			15,042,459	0.03%
93	MINSA	00124	HR2	15,042,459	0.03%
	Swaps Entregables			405,250	0.00%
SWP	2TIEMXP	250403		-125,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		530,250	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			603,170,839	1.08%
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	502,702,050	0.90%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,468,789	0.18%
	Udibonos			2,528,680,738	4.51%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	2,528,680,738	4.51%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,315,213,703	2.34%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	424,642,042	0.76%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	363,144,769	0.65%
95	PEMEX	19	mxAAA	250,940,755	0.45%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,925,352	0.22%
95	FEFA	23G	mxAAA	78,832,747	0.14%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	76,728,038	0.14%
	Reportos			909,580,697	1.62%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	224,042,656	0.40%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	214,583,063	0.38%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	120,035,166	0.21%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	100,029,438	0.18%
LF	BONDESF	340323	AAA(mex)	98,909,631	0.18%
LD	BONDES D	241219	AAA(mex)	87,034,751	0.16%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	27,095,820	0.05%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	24,855,521	0.04%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	12,994,652	0.02%

Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				5,674,554,445	10.11%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,404,454,954	2.50%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	1,067,450,672	1.90%
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	1,002,979,020	1.79%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	998,885,020	1.78%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	701,040,844	1.25%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	499,743,935	0.89%
TOTAL CARTERA				56,115,707,732	100.00%
ACTIVO NETO				56,039,803,576	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.049 %
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."