

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			353,716,223	21.47%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	149,926,255	9.10%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	86,373,036	5.24%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	70,817,194	4.30%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,237,434	1.96%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,362,305	0.87%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			45,302,667	2.75%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,319,644	1.60%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,340,036	0.87%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,642,987	0.28%
	Certificados Bursátiles Corporativos			493,938,519	29.97%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	43,445,200	2.64%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,238,541	1.71%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,630,725	1.56%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	24,596,394	1.49%
91	OSM	15U	mxAA-	23,378,633	1.42%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,422,082	1.30%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,409,628	1.30%
91	GAP	23-2L	mxAAA	20,924,729	1.27%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,238,049	1.23%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,775,649	1.20%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,335,351	1.17%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,914,815	1.15%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,727,383	1.14%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,685,357	1.13%
91	SALUD	21	HR A+	18,102,404	1.10%
91	SALUD	20	HR A+	16,658,747	1.01%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,353,082	0.99%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,118,622	0.92%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	13,884,434	0.84%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,702,920	0.77%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,713,366	0.71%

91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,897,836	0.54%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,257,147	0.44%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,031,844	0.43%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,518,386	0.40%
91	GHEMA	23	HR BBB+	5,992,420	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,270,617	0.32%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,935,207	0.30%
91	NM	15	mxAA+	4,015,602	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,118,436	0.19%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,918,168	0.18%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,562,915	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,888,182	0.12%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,289,625	0.08%
91	GHO CB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	747,417	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	628,916	0.04%
91	DMXI	15	mx D	468,694	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,905	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			91,279,853	5.54%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,206,635	2.62%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	33,321,964	2.02%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	14,751,253	0.90%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			33,435,378	2.03%
1ISP	SHV	*		33,435,378	2.03%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,510,829	0.88%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,510,829	0.88%
	Udibonos			522,458,127	31.71%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	223,999,731	13.59%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	159,950,213	9.71%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	138,508,183	8.41%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			40,412,498	2.45%
95	FOVISC B	19U	Aaa.mx	11,738,239	0.71%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,039,708	0.61%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,970,072	0.42%
95	FOVISC B	17-2U	Aaa.mx	6,151,292	0.37%
95	FOVISC B	19-2U	AAA (mex)	3,990,635	0.24%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,522,551	0.09%
	Reportos			52,826,842	3.21%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	52,826,842	3.21%
	TOTAL CARTERA			1,647,880,936	100.00%

ACTIVO NETO

1,648,347,802

Cartera al:

31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.559 %

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."