

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			9,981,159,310	17.79%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	3,476,069,085	6.20%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	3,222,523,046	5.74%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,006,932,851	3.58%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	495,671,250	0.88%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	485,108,200	0.87%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	294,854,877	0.53%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			670,594,341	1.20%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	670,594,341	1.20%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,475,193,247	2.63%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	834,093,298	1.49%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	565,481,912	1.01%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,618,036	0.14%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,103,793,714	3.75%
94	BACTIN	22	AA (mex)	450,625,401	0.80%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	404,033,700	0.72%
94	BACTIN	23	AA (mex)	401,159,964	0.72%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,049,904	0.64%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,379,494	0.46%
94	BACTIN	21	AA (mex)	231,545,250	0.41%
	Certificados Bursátiles Corporativos			5,593,909,514	9.97%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	402,790,572	0.72%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	402,746,232	0.72%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	364,934,102	0.65%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	349,983,457	0.62%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	321,173,268	0.57%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	301,455,093	0.54%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	265,274,840	0.47%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	251,074,968	0.45%
91	TPLAYCB	24	HR AA	250,758,595	0.45%

91	AB&CCB	22	AAA (mex)	248,399,025	0.44%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	212,840,494	0.38%
91	NM	24	mxAA+	203,810,881	0.36%
91	GAP	24	mxAAA	200,503,568	0.36%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,600,485	0.33%
91	LALA	19-2	AA (mex)	160,078,021	0.29%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	151,059,018	0.27%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,023,077	0.27%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	147,920,785	0.26%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	143,251,833	0.26%
91	FINN	18	A- (mex)	114,555,891	0.20%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,671,064	0.18%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	95,964,202	0.17%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	88,093,209	0.16%
91	DAIMLER	23	mxAAA	86,836,926	0.16%
91	LAB	23	AA (mex)	85,977,041	0.15%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	81,130,042	0.15%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	53,766,224	0.10%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,150,177	0.09%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	41,604,878	0.07%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	35,676,908	0.06%
91	AERMXCB	19	AA+/M	22,558,783	0.04%
91	GAP	21V	mxAAA	15,128,217	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,117,637	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

23,753,449,294

42.34%

BI	CETES	250821	AAA(mex)	3,553,147,770	6.33%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,783,754,339	4.96%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	2,495,870,941	4.45%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	2,161,653,808	3.85%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,874,109,913	3.34%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,760,965,200	3.14%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	1,752,405,560	3.12%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,489,470,001	2.66%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,439,004,900	2.57%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,057,365,730	1.89%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	913,895,226	1.63%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	904,051,728	1.61%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	627,197,209	1.12%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	475,576,218	0.85%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	464,980,750	0.83%

Chequera Euros

60,497

0.00%

CHE	40-012	5500702		60,497	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

Chequera Dolares

53,437,126

0.10%

CHD	40-133	8035859		53,437,126	0.10%
-----	--------	---------	--	------------	-------

	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			605,933,038	1.08%
D8	CAF0627	90	AA-	405,576,249	0.72%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,356,789	0.36%
	Titulos de Credito Extranjeros			664,056,414	1.18%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	357,637,675	0.64%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	170,023,464	0.30%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	136,395,275	0.24%
	Eurobonos de Empresas Privadas			354,167,749	0.63%
D2	CAF872	310222	AA-	254,227,604	0.45%
D2	KEXIM	250426	AA	99,940,145	0.18%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			15,074,899	0.03%
93	MINSA	00124	HR2	15,074,899	0.03%
	Swaps Entregables			858,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		648,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	250403		210,000	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			604,443,673	1.08%
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	503,762,720	0.90%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,680,953	0.18%
	Udibonos			2,540,816,215	4.53%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	2,540,816,215	4.53%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,315,351,409	2.35%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	426,528,472	0.76%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	360,826,621	0.64%
95	PEMEX	19	mxAAA	251,556,510	0.45%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,118,169	0.21%
95	FEFA	23G	mxAAA	78,999,180	0.14%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	77,322,457	0.14%
	Reportos			701,212,568	1.25%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	292,994,860	0.52%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	200,058,249	0.36%
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	108,130,371	0.19%
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	50,014,583	0.09%
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	50,014,505	0.09%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			5,666,657,796	10.10%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,395,880,752	2.49%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	1,069,670,922	1.91%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	1,000,976,050	1.78%

LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	996,855,040	1.78%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	702,497,327	1.25%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	500,777,705	0.89%
TOTAL CARTERA				56,100,168,804	100.00%
ACTIVO NETO				55,822,129,926	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.062 %
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."