

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			925,733,560	9.60%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	291,064,920	3.02%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	244,664,232	2.54%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	191,816,848	1.99%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	98,284,959	1.02%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,943,376	0.66%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	35,959,225	0.37%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			227,010,008	2.35%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	227,010,008	2.35%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			599,241,502	6.21%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	599,241,502	6.21%
	Certificados Bursátiles Bancarios			70,487,813	0.73%
94	COMPART	20	AA (mex)	70,487,813	0.73%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,727,927,353	28.28%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	195,324,686	2.03%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	191,682,877	1.99%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,663,580	1.94%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,519,820	1.87%
91	GICSA	19	B/M	173,594,139	1.80%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	170,747,368	1.77%
91	AERMXCB	19	AA+/M	164,826,274	1.71%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	160,947,731	1.67%
91	TPLAYCB	24	HR AA	150,455,157	1.56%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	144,032,016	1.49%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	119,842,547	1.24%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,429,987	1.04%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	93,907,993	0.97%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	87,703,448	0.91%
91	CADU	20V	A/M	73,556,241	0.76%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	68,611,469	0.71%

91	LAMOSA	19	AA (mex)	66,202,465	0.69%
91	IDEI	23+V	HR BBB	48,738,757	0.51%
91	TPLAYCB	20	HR AA	44,526,827	0.46%
91	GHEMA	23	HR BBB+	43,051,289	0.45%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	40,084,924	0.42%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	35,247,104	0.37%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	34,283,759	0.36%
91	GICSA	17	B/M	23,678,013	0.25%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	22,485,488	0.23%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,642,363	0.22%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	20,189,681	0.21%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,176,496	0.21%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	16,670,748	0.17%
91	AMX	22	AAA (mex)	11,859,293	0.12%
91	VINTE	17-2	HR AA-	10,000,928	0.10%
91	BRX	22	AA (mex)	4,046,622	0.04%
91	GICSA	15	B/M	2,197,263	0.02%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			917,685,765	9.51%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	506,719,680	5.25%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	276,940,590	2.87%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	134,025,495	1.39%
	Chequera Euros			90,762	0.00%
CHE	40-012	5514622		90,762	0.00%
	Chequera Dolares			21,119,636	0.22%
CHD	40-110	8377998		19,879,620	0.21%
CHD	40-133	8030298		1,240,015	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			194,547,974	2.02%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	194,547,974	2.02%
	Eurobonos de Empresas Privadas			423,712,673	4.39%
D2	CAF872	310222	AA-	423,712,673	4.39%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			72,607,928	0.75%
93	AMX	13024	F1+ (mex)	72,607,928	0.75%
	Swaps Entregables			259,700	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		154,700	0.00%
SWP	2TIEMXP	250403		105,000	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			95,329,056	0.99%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,329,056	0.99%
	Udibonos			956,075,076	9.91%

S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	956,075,076	9.91%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,458,917,533	15.13%
95	PEMEX	19	mxAAA	664,109,186	6.89%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	473,988,146	4.91%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	320,820,200	3.33%
	Reportos			954,640,369	9.90%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	433,488,429	4.49%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	268,078,118	2.78%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	200,058,372	2.07%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	53,015,449	0.55%
	TOTAL CARTERA			9,645,386,708	100.00%
	ACTIVO NETO			9,703,677,800	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.160 %
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."