

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				359,643,355	21.49%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	153,118,336	9.15%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	87,650,611	5.24%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	71,907,954	4.30%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,502,249	1.94%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,464,204	0.86%
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				45,736,958	2.73%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,591,410	1.59%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,492,376	0.87%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,653,172	0.28%
Certificados Bursátiles Corporativos				498,001,845	29.76%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	43,881,285	2.62%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,490,124	1.70%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,852,909	1.55%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	24,923,346	1.49%
91	OSM	15U	mxAA-	23,633,294	1.41%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,580,829	1.29%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,564,677	1.29%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,137,877	1.26%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,509,211	1.23%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,855,116	1.19%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,537,543	1.17%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,103,604	1.14%
91	LAMOSAS	19	AA (mex)	18,853,516	1.13%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,841,959	1.13%
91	SALUD	21	HR A+	17,971,855	1.07%
91	SALUD	20	HR A+	16,701,016	1.00%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,475,040	0.99%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,331,014	0.92%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,082,926	0.84%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,803,259	0.77%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,872,238	0.71%

91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,989,702	0.54%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,306,044	0.44%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,047,744	0.42%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,576,313	0.39%
91	GHEMA	23	HR BBB+	6,008,358	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,303,282	0.32%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,957,842	0.30%
91	NM	15	mxAA+	4,026,899	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,163,245	0.19%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,929,773	0.18%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,583,425	0.15%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,805,568	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,297,616	0.08%
91	GHOCB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	750,394	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	636,821	0.04%
91	DMXI	15	mxD	475,181	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,910	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			91,712,049	5.48%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,415,255	2.59%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	33,466,475	2.00%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	14,830,319	0.89%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			33,085,357	1.98%
1ISP	SHV	*		33,085,357	1.98%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,724,466	0.88%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,724,466	0.88%
	Udibonos			529,588,337	31.65%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	227,599,866	13.60%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	161,429,475	9.65%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	140,558,996	8.40%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			40,830,116	2.44%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,919,357	0.71%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,165,592	0.61%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,998,260	0.42%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,184,424	0.37%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,034,152	0.24%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,528,331	0.09%
	Reportos			60,107,507	3.59%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	60,107,507	3.59%
	TOTAL CARTERA			1,673,429,990	100.00%

ACTIVO NETO

1,664,295,652

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.540 %

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."