

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij			104,801,789	1.47%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	104,801,789	1.47%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			100,022,412	1.40%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	100,022,412	1.40%
	Certificados Bursátiles Bancarios			316,331,938	4.43%
94	BACTIN	23	AA (mex)	201,902,110	2.83%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	64,036,280	0.90%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	50,393,548	0.71%
	Certificados Bursátiles Corporativos			3,225,684,631	45.20%
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	255,643,429	3.58%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	163,536,886	2.29%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	131,513,662	1.84%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	130,591,386	1.83%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,892,899	1.74%
91	EDUCA	23L	HR AAA	123,112,744	1.73%
91	AERMXCB	19	AA+/M	122,154,126	1.71%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,584,967	1.68%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	100,874,222	1.41%
91	NM	24	mxAA+	100,864,096	1.41%
91	MEGA	24X	AAA (mex)	100,767,043	1.41%
91	DONDE	23	HR AA	100,610,388	1.41%
91	SALUD	21	HR A+	100,568,909	1.41%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,473,053	1.41%
91	TPLAYCB	20	HR AA	99,228,868	1.39%
91	GICSA	19	B/M	95,162,583	1.33%
91	GAP	21	mxAAA	91,592,254	1.28%
91	ARA	23X	mxAA-	90,277,450	1.27%
91	LALA	19-2	AA (mex)	87,651,021	1.23%
91	SALUD	20	HR A+	80,769,682	1.13%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,835,052	1.06%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,689,462	1.06%

91	TPLAY	22	HR A	75,455,352	1.06%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	72,471,362	1.02%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	64,280,801	0.90%
91	VOLARCB	23	HR AA+	60,129,229	0.84%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	59,692,769	0.84%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	58,962,358	0.83%
91	GHEMA	23	HR BBB+	49,936,831	0.70%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	40,476,559	0.57%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,249,972	0.56%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	38,999,017	0.55%
91	GICSA	17	B/M	36,630,883	0.51%
91	LAB	23	AA (mex)	35,192,699	0.49%
91	GASA	24	HR AA+	30,147,427	0.42%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,011,419	0.42%
91	CYDSASA	23	HR AA+	21,090,807	0.30%
91	HYCSA	24	HR AA	20,059,205	0.28%
91	GAP	20	mxAAA	11,280,790	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	10,222,968	0.14%
91	GEOCB	11-2	HR D	0	0.00%

Certificados De La Tesorería De La Federación

2,634,825,297

36.92%

BI	CETES	260806	AAA(mex)	566,782,920	7.94%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	556,276,438	7.80%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	460,393,000	6.45%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	445,617,879	6.25%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	368,118,568	5.16%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	237,636,493	3.33%

Chequera Dolares

2,271,348

0.03%

CHD	40-133	8034399		2,271,348	0.03%
-----	--------	---------	--	-----------	-------

Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial

147,916,912

2.07%

93	ELEKTRA	00124	HR1	120,398,738	1.69%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,103,749	0.21%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	12,414,425	0.17%

Swaps Entregables

-15,509,100

-0.22%

SWP	2TIEMXP	250812		-1,198,500	-0.02%
SWP	2TIEMXP	250815		-851,000	-0.01%
SWP	2TIEMXP	260218		-2,072,250	-0.03%
SWP	2TIEMXP	260317		-2,200,000	-0.03%
SWP	2TIEMXP	261005		-8,635,900	-0.12%
SWP	2TIEMXP	261006		-4,712,000	-0.07%
SWP	2TIEMXP	261015		-1,832,700	-0.03%
SWP	2TIEMXP	250403		-125,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260610		5,469,000	0.08%
SWP	2TIEMXP	250207		530,250	0.01%

SWP	2TIEMXP	241111		119,000	0.00%
	Udibonos			100,050,067	1.40%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	100,050,067	1.40%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			296,766,142	4.16%
95	PEMEX	19	mxAAA	205,771,419	2.88%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,994,723	1.28%
	Reportos			222,641,312	3.12%
IM	BPAG28	270204	AAA(mex)	222,641,312	3.12%
	TOTAL CARTERA			7,135,802,748	100.00%
	ACTIVO NETO			7,148,135,377	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.300 % Var Promedio: 0.116 %
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."