

MEDIANO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AA/1CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>90,257,318</b>	<b>2.35%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	90,257,318	2.35%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>185,788,993</b>	<b>4.85%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,062,089	1.62%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,349,677	1.55%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,879,664	0.91%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,497,563	0.77%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,020,345,050</b>	<b>52.70%</b>
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,357,195	3.92%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	123,460,847	3.22%
91	CIRCLEK	22	HR A+	120,227,805	3.14%
91	VOLARCB	23	HR AA+	101,135,806	2.64%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,929,530	2.63%
91	ARA	23X	mxAA-	100,814,745	2.63%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,511,018	2.62%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	100,446,807	2.62%
91	DONDE	23	HR AA	100,123,035	2.61%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,048,011	2.61%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	90,678,250	2.37%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,309,392	2.36%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,019,014	2.09%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,947,531	1.98%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,309,229	1.96%
91	TPLAY	22	HR A	75,047,550	1.96%
91	SALUD	20	HR A+	74,645,700	1.95%
91	TPLAYCB	20	HR AA	54,140,793	1.41%
91	SALUD	21	HR A+	50,430,048	1.32%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,229,827	1.05%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,197,316	1.05%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,045,374	1.05%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	37,335,745	0.97%
91	GASA	24	HR AA+	20,200,631	0.53%

91	HYCSA	24	HR AA	20,165,608	0.53%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,093,201	0.52%
91	FUTILCB	24S	mxAAA	19,845,642	0.52%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,649,401	0.46%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>554,105,760</b>	<b>14.45%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	287,723,963	7.51%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	158,693,572	4.14%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	107,688,225	2.81%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>180,295</b>	<b>0.01%</b>
CHD	40-133	8355257		180,295	0.01%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come</b>			<b>109,703,348</b>	<b>2.86%</b>
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,813,394	2.63%
93	HYCSA	00123	HR2	8,889,954	0.23%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>2,063,700</b>	<b>0.05%</b>
SWP	2TIEMXP	260218		1,388,250	0.04%
SWP	2TIEMXP	250207		475,000	0.01%
SWP	2TIEMXP	240926		130,800	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		69,650	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>124,725,516</b>	<b>3.25%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,725,516	3.25%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede</b>			<b>90,367,718</b>	<b>2.36%</b>
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,367,718	2.36%
	<b>Reportos</b>			<b>656,339,613</b>	<b>17.12%</b>
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	491,655,009	12.82%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	164,684,604	4.30%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,833,877,311</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,842,541,972</b>	

**Cartera al: 19/09/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.019 %**

**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."**