

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			4,811,473,114	9.22%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,978,910,645	3.79%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	1,636,007,363	3.14%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	1,196,555,107	2.29%
	Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Ta			105,140,444	0.20%
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	105,140,444	0.20%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			1,477,869,269	2.83%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	835,917,617	1.60%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	566,761,856	1.09%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,189,796	0.14%
	Certificados de Depósito			350,340,694	0.67%
F	BMULTIV	23061	mxA-2	350,340,694	0.67%
	Certificados Bursátiles Bancarios			2,108,901,679	4.04%
94	BACTIN	22	AA (mex)	451,663,214	0.87%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	405,082,952	0.78%
94	BACTIN	23	AA (mex)	402,148,092	0.77%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	361,888,276	0.69%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	255,964,861	0.49%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,154,286	0.45%
	Certificados Bursátiles Corporativos			5,203,554,153	9.98%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	400,192,044	0.77%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	400,095,068	0.77%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	365,769,333	0.70%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	350,768,517	0.67%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	319,093,185	0.61%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	302,141,709	0.58%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	265,339,995	0.51%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	253,158,435	0.49%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	246,921,693	0.47%

91	PCARFM	24	AAA (mex)	213,324,810	0.41%
91	NM	24	mxAA+	204,279,096	0.39%
91	GAP	24	mxAAA	200,966,602	0.39%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	181,393,882	0.35%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,094,652	0.31%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	156,180,919	0.30%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	151,394,295	0.29%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	144,513,421	0.28%
91	FINN	18	A- (mex)	114,810,675	0.22%
91	VOLARCB	23	HR AA+	101,135,806	0.19%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,231,502	0.18%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	88,294,389	0.17%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,033,768	0.17%
91	LAB	23	AA (mex)	85,414,401	0.16%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,602,889	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,873,452	0.11%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,287,284	0.10%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	41,208,250	0.08%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	38,843,644	0.07%
91	AERMxCB	19	AA+/M	24,009,891	0.05%
91	GAP	21V	mxAAA	15,032,836	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,147,709	0.02%

Certificados De La Tesorería De La Federación

22,507,287,174

43.15%

BI	CETES	250821	AAA(mex)	3,515,634,646	6.74%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,746,502,159	5.27%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	2,476,326,917	4.75%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	2,332,828,982	4.47%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	2,135,211,259	4.09%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,736,802,360	3.33%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,475,802,602	2.83%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,420,008,450	2.72%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	1,321,108,583	2.53%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	902,868,333	1.73%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	889,508,864	1.71%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	618,812,023	1.19%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	471,592,044	0.90%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	460,024,200	0.88%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	4,255,752	0.01%

Chequera Euros

60,784

0.00%

CHE	40-012	5500702		60,784	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

Chequera Dolares

116,265,590

0.22%

CHD	40-133	8035859		116,265,590	0.22%
-----	--------	---------	--	-------------	-------

Títulos Emisoras Extranjeras SIC

607,409,076

1.16%

D8	CAF0627	90	AA-	406,565,070	0.78%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	200,844,005	0.39%
	Titulos de Credito Extranjeros			675,225,162	1.29%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	363,465,823	0.70%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	173,961,741	0.33%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	137,797,598	0.26%
	Eurobonos de Empresas Privadas			362,738,604	0.70%
D2	CAF872	310222	AA-	259,062,994	0.50%
D2	KEXIM	250426	AA	103,675,610	0.20%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			130,940,580	0.25%
93	TPLAY	00223	HR2	100,786,114	0.19%
93	MINSA	00124	HR2	15,108,314	0.03%
93	TPLAY	00124	HR2	15,046,153	0.03%
	Swaps Entregables			-24,229,742	-0.05%
SWP	2TIEMXP	241025		-1,467,400	0.00%
SWP	1MXPTIE	290726		-6,748,400	-0.01%
SWP	1MXPTIE	340804		-5,178,800	-0.01%
SWP	1MXPTIE	340804		-5,313,600	-0.01%
SWP	1MXPTIE	340808		-6,211,500	-0.01%
SWP	1USDSUS	260917		-22,542	0.00%
SWP	2TIEMXP	250207		712,500	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			100,912,408	0.19%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,912,408	0.19%
	Udibonos			24,845,016	0.05%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	24,845,016	0.05%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			1,235,353,925	2.37%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	421,716,015	0.81%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	361,637,557	0.69%
95	PEMEX	19	mxAAA	252,404,720	0.48%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,419,177	0.23%
95	FEFA	23G	mxAAA	79,176,456	0.15%
	Reportos			6,095,835,616	11.69%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	3,156,708,844	6.05%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	1,753,187,953	3.36%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	500,149,688	0.96%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	251,139,384	0.48%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	211,187,969	0.41%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	120,035,830	0.23%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	100,029,841	0.19%

IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	3,396,107	0.01%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			6,276,999,292	12.03%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,398,395,544	2.68%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	1,071,599,800	2.05%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	1,002,937,980	1.92%
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	998,760,300	1.92%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	703,862,236	1.35%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	599,735,142	1.15%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	501,708,290	0.96%
	TOTAL CARTERA			52,166,922,838	100.00%
	ACTIVO NETO			52,482,059,743	

Cartera al: 19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.031 %

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."