

MEDIANO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/2CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Trimestra</b>			<b>51,254,877</b>	<b>1.55%</b>
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,254,877	1.55%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>664,454,820</b>	<b>20.07%</b>
BI	CETES	251030	AAA(mex)	179,611,660	5.42%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	172,301,160	5.20%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	145,317,420	4.39%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	49,008,795	1.48%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	47,694,700	1.44%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	47,519,875	1.44%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,001,210	0.70%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>123,059</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8031130		123,059	0.00%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come</b>			<b>256,641,931</b>	<b>7.75%</b>
93	START	02724	HR+1	36,333,074	1.10%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	24,618,645	0.74%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	19,752,774	0.60%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,626,344	0.59%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,130,148	0.58%
93	START	02624	HR+1	18,005,616	0.54%
93	START	02824	HR+1	17,717,917	0.54%
93	START	02124	HR+1	17,005,690	0.51%
93	START	02224	HR+1	12,081,435	0.37%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	10,741,438	0.32%
93	START	03324	HR+1	10,046,278	0.30%
93	START	02324	HR+1	10,046,011	0.30%
93	START	01724	HR+1	10,025,982	0.30%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,876,489	0.30%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,506,112	0.29%
93	START	03424	HR+1	5,012,221	0.15%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,646,605	0.14%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,469,153	0.08%

	<b>Pagare Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL</b>			<b>187,873,536</b>	<b>5.67%</b>
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	83,690,754	2.53%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	53,204,303	1.61%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	50,978,479	1.54%
	<b>Reportos</b>			<b>1,143,588,890</b>	<b>34.54%</b>
BI	CETES	250123	AAA(mex)	433,822,238	13.10%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	356,923,973	10.78%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	352,842,679	10.66%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>1,007,464,701</b>	<b>30.42%</b>
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	499,258,235	15.08%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,043,234	3.02%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,798,570	3.01%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,565,319	3.01%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,513,192	3.01%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,759,916	1.50%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,582,335	1.50%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	9,943,901	0.30%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,311,401,814</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,371,611,603</b>	

Cartera al: 19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.012 %

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."