

MEDIANO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/2CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Trimestra			51,732,483	1.43%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,732,483	1.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			667,999,085	18.42%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	180,323,300	4.97%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	172,750,520	4.76%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	146,454,630	4.04%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	49,411,930	1.36%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,055,410	1.33%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	47,866,040	1.32%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,137,255	0.64%
	Chequera Dolares			126,873	0.00%
CHD	40-133	8031130		126,873	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			273,560,821	7.54%
93	START	02724	HR+1	36,328,736	1.00%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	24,821,130	0.68%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,798,424	0.55%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,296,031	0.53%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	18,990,028	0.52%
93	START	02624	HR+1	18,009,414	0.50%
93	START	02824	HR+1	17,715,802	0.49%
93	START	02124	HR+1	17,008,126	0.47%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	16,809,282	0.46%
93	START	02224	HR+1	12,083,325	0.33%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	10,837,257	0.30%
93	START	02324	HR+1	10,047,090	0.28%
93	START	03324	HR+1	10,045,079	0.28%
93	START	01724	HR+1	10,024,569	0.28%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,962,173	0.28%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,592,996	0.27%
93	START	03424	HR+1	5,011,898	0.14%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,688,553	0.13%

93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,490,908	0.07%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL)			289,346,708	7.98%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	100,105,767	2.76%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	84,340,119	2.33%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	53,629,057	1.48%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	51,271,765	1.41%
	Reportos			1,036,564,254	28.58%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	679,643,194	18.74%
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	356,921,060	9.84%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,307,152,063	36.05%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	499,277,365	13.77%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	200,219,814	5.52%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,379,272	3.02%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,043,348	2.76%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,800,575	2.75%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,562,275	2.75%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,519,824	2.74%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,767,636	1.37%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,581,954	1.37%
	TOTAL CARTERA			3,626,482,287	100.00%
	ACTIVO NETO			3,514,333,623	

Cartera al: 17/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.011 %

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."