

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			51,432,885	1.30%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,432,885	1.30%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			631,614,138	15.96%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	184,241,400	4.65%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	176,360,400	4.46%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	149,456,550	3.78%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,056,920	1.24%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	48,873,200	1.24%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,625,668	0.60%
	Chequera Dolares			128,967	0.00%
CHD	40-133	8031130		128,967	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			364,928,918	9.22%
93	START	05024	HR+1	59,653,057	1.51%
93	START	04824	HR+1	49,190,910	1.24%
93	START	04924	HR+1	30,072,213	0.76%
93	START	04124	HR+1	26,007,124	0.66%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,376,931	0.64%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,731,320	0.50%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,412,653	0.49%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	19,180,487	0.49%
93	START	02624	HR+1	18,075,434	0.46%
93	START	02824	HR+1	17,642,494	0.45%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,182,796	0.43%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	11,074,352	0.28%
93	START	02324	HR+1	10,086,557	0.26%
93	START	04324	HR+1	10,064,917	0.25%
93	START	03324	HR+1	10,004,278	0.25%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,804,828	0.25%
93	START	04724	HR+1	5,032,153	0.13%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,791,573	0.12%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,544,840	0.06%

	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			291,748,250	7.37%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	102,367,879	2.59%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	86,116,269	2.18%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	52,414,229	1.32%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	50,849,873	1.29%
	Reportos			1,107,818,535	27.99%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	505,646,704	12.77%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	275,261,995	6.95%
LD	BONDESD	260409	AAA(mex)	214,291,909	5.41%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	112,617,926	2.85%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,510,751,666	38.17%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	501,371,735	12.67%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	199,455,490	5.04%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,845,832	2.78%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	100,353,178	2.54%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,228,350	2.53%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	100,087,308	2.53%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,976,317	2.53%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,971,740	2.53%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,660,715	2.52%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,996,534	1.26%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,804,468	1.26%
	TOTAL CARTERA			3,958,423,359	100.00%
	ACTIVO NETO			3,968,551,405	

Cartera al: **26/12/2024**

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.009 %

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."