

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 Trimestral De Ir			51,014,367	1.39%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,014,367	1.39%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			626,609,565	17.01%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	182,773,500	4.96%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	174,987,960	4.75%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	148,278,915	4.03%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,663,865	1.32%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	48,474,040	1.32%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,431,285	0.64%
	Chequera Dolares			130,383	0.00%
CHD	40-133	8031130		130,383	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			253,901,504	6.89%
93	START	04124	HR+1	26,007,811	0.71%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,153,905	0.68%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,558,464	0.53%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,233,037	0.52%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	18,998,047	0.52%
93	START	02624	HR+1	18,084,401	0.49%
93	START	02824	HR+1	17,644,310	0.48%
93	START	02124	HR+1	17,079,311	0.46%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,024,757	0.46%
93	START	02224	HR+1	12,028,911	0.33%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	10,982,313	0.30%
93	START	04324	HR+1	10,066,391	0.27%
93	START	03324	HR+1	10,005,301	0.27%
93	START	02324	HR+1	10,004,194	0.27%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,721,874	0.26%
93	START	03424	HR+1	5,032,890	0.14%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,751,574	0.13%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,524,012	0.07%

	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			289,372,577	7.86%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	101,533,076	2.76%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	85,410,569	2.32%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	51,989,668	1.41%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	50,439,264	1.37%
	Reportos			1,152,298,411	31.28%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	995,436,154	27.02%
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	156,862,257	4.26%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,310,142,041	35.57%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	501,366,380	13.61%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	199,375,812	5.41%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,849,583	2.98%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,226,798	2.72%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,976,770	2.71%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,936,044	2.71%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,649,841	2.71%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,975,805	1.36%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,785,009	1.35%
	TOTAL CARTERA			3,683,468,848	100.00%
	ACTIVO NETO			3,668,306,559	

Cartera al: 28/11/2024

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."