

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			90,551,109	2.67%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	90,551,109	2.67%
	Certificados Bursátiles Bancarios			186,417,950	5.50%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,268,797	1.84%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,563,584	1.76%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,991,680	1.03%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,593,889	0.87%
	Certificados Bursátiles Corporativos			1,900,773,683	56.10%
91	LALA	19-2	AA (mex)	150,851,636	4.45%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,065,475	3.66%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,410,830	3.52%
91	ARA	23X	mxAA-	101,073,165	2.98%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,839,154	2.98%
91	DONDE	23	HR AA	100,479,554	2.97%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,476,402	2.97%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,357,293	2.96%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,331,159	2.96%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	91,079,001	2.69%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,606,854	2.67%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,282,316	2.37%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,626,422	2.23%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,604,490	2.23%
91	TPLAY	22	HR A	75,321,407	2.22%
91	SALUD	20	HR A+	74,150,553	2.19%
91	TPLAYCB	20	HR AA	53,785,157	1.59%
91	SALUD	21	HR A+	50,617,281	1.49%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,390,186	1.19%
91	DAIMLER	23	mxAAA	40,332,446	1.19%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,194,487	1.19%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	37,093,091	1.10%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,163,751	0.60%
91	GASA	24	HR AA+	20,071,424	0.59%

91	HYCSA	24	HR AA	20,030,006	0.59%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,540,144	0.52%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			549,263,871	16.21%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	284,505,975	8.40%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	157,515,778	4.65%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	106,295,388	3.14%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	946,731	0.03%
	Chequera Dolares			184,227	0.01%
CHD	40-133	8355257		184,227	0.01%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			109,035,776	3.22%
93	ELEKTRA	00124	HR1	100,202,719	2.96%
93	HYCSA	00123	HR2	8,833,057	0.26%
	Swaps Entregables			-170,800	-0.01%
SWP	2TIEMXP	240905		-9,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	260218		-560,500	-0.02%
SWP	2TIEMXP	250207		191,000	0.01%
SWP	2TIEMXP	240926		130,000	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		77,700	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			124,040,896	3.66%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,040,896	3.66%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			194,796,394	5.75%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	104,485,667	3.08%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	90,310,727	2.67%
	Reportos			233,321,744	6.89%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	233,321,744	6.89%
	TOTAL CARTERA			3,388,214,850	100.00%
	ACTIVO NETO			3,397,827,875	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.023 %
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."