

## MEDIANO PLAZO GENERAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>8,371,413,625</b>	<b>17.15%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	3,929,379,287	8.05%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	1,967,353,042	4.03%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	1,520,901,943	3.12%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	929,636,938	1.91%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	24,142,416	0.05%
	<b>Comp.Cupón Segreg.Princ.Bono Desarr.Gob.Fed.Tasa Fij</b>			<b>103,590,525</b>	<b>0.21%</b>
MP	BONOS	260903	AAA(mex)	103,590,525	0.21%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>1,482,678,420</b>	<b>3.04%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	838,638,559	1.72%
CD	KDB	22V	AAA (mex)	568,620,126	1.17%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,419,735	0.16%
	<b>Certificados de Depósito</b>			<b>351,459,339</b>	<b>0.72%</b>
F	BMULTIV	23061	mxA-2	351,459,339	0.72%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>2,112,602,856</b>	<b>4.33%</b>
94	BACTIN	22	AA (mex)	453,325,770	0.93%
94	BACTIN	23	AA (mex)	403,461,340	0.83%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	402,828,548	0.83%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	363,192,588	0.74%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	256,818,346	0.53%
94	BACTIN	21	AA (mex)	232,976,264	0.48%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>4,772,996,132</b>	<b>9.78%</b>
91	GCARSO	24	AAA (mex)	401,429,172	0.82%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	401,411,580	0.82%
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	363,753,128	0.75%
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	351,877,169	0.72%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	320,144,217	0.66%
91	SIGMA	24	AAA (mex)	300,453,000	0.62%
91	GCARSO	24-2	AAA (mex)	257,121,130	0.53%

91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	252,088,073	0.52%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	248,130,950	0.51%
91	NM	24	mxAA+	204,991,671	0.42%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	182,151,909	0.37%
91	LALA	19-2	AA (mex)	159,617,825	0.33%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	150,496,739	0.31%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	149,718,078	0.31%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	140,443,420	0.29%
91	FINN	18	A- (mex)	112,032,011	0.23%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,476,402	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	96,582,739	0.20%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	88,585,890	0.18%
91	DAIMLER	23	mxAAA	87,326,346	0.18%
91	LAB	23	AA (mex)	85,688,904	0.18%
91	VIVAACB	22L	HR AA+	80,959,112	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	55,205,262	0.11%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	50,487,732	0.10%
91	BIMBO	16	AAA (mex)	42,321,413	0.09%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	38,595,115	0.08%
91	AERMXCB	19	HR AA+	25,736,424	0.05%
91	GAP	21V	mxAAA	15,079,562	0.03%
91	OMA	21V	AAA (mex)	10,091,162	0.02%

**Certificados De La Tesorería De La Federación**

**20,519,208,943**

**42.04%**

BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,728,437,579	5.59%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	2,444,298,151	5.01%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	2,318,362,441	4.75%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	2,119,118,775	4.34%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,726,022,160	3.54%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	1,591,780,190	3.26%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	1,459,296,801	2.99%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,410,834,900	2.89%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	1,401,928,026	2.87%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	896,167,414	1.84%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	882,118,212	1.81%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	614,611,094	1.26%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	465,906,708	0.96%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	456,106,100	0.94%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	4,220,392	0.01%

**Chequera Euros**

**61,604**

**0.00%**

CHE	40-012	5500702		61,604	0.00%
-----	--------	---------	--	--------	-------

**Chequera Dolares**

**578,889**

**0.00%**

CHD	40-133	8035859		578,889	0.00%
-----	--------	---------	--	---------	-------

**Títulos Emisoras Extranjeras SIC**

**599,916,608**

**1.23%**

D8	CAF0627	90	AA-	398,401,864	0.82%
D8	MSF0925	FLOAT	A-	201,514,744	0.41%
<b>Títulos de Credito Extranjeros</b>				<b>649,757,535</b>	<b>1.33%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	351,694,297	0.72%
JE	AMX	0134X	AAA (mex)	165,729,693	0.34%
JE	AMX	0131X	AAA (mex)	132,333,545	0.27%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>				<b>353,650,041</b>	<b>0.73%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	250,565,400	0.51%
D2	KEXIM	250426	AA	103,084,641	0.21%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>130,292,698</b>	<b>0.27%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	100,170,600	0.21%
93	TPLAY	00124	HR2	15,100,138	0.03%
93	MINSA	00124	HR2	15,021,960	0.03%
<b>Swaps Entregables</b>				<b>7,433,450</b>	<b>0.02%</b>
SWP	2TIEMXP	241025		-1,468,550	0.00%
SWP	1MXPTIE	290726		-1,748,600	0.00%
SWP	1MXPTIE	340808		5,373,300	0.01%
SWP	1MXPTIE	340804		2,561,600	0.01%
SWP	1MXPTIE	340804		2,429,200	0.01%
SWP	2TIEMXP	250207		286,500	0.00%
<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>				<b>100,358,498</b>	<b>0.21%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	100,358,498	0.21%
<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>				<b>2,198,277,844</b>	<b>4.50%</b>
95	PEMEX	13-2	mxAAA	963,890,409	1.98%
95	CFE	23-2X	AAA (mex)	421,450,058	0.86%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	362,838,672	0.74%
95	PEMEX	19	mxAAA	250,539,658	0.51%
95	CFE	21-2	AAA (mex)	120,819,731	0.25%
95	FEFA	23G	mxAAA	78,739,316	0.16%
<b>Reportos</b>				<b>520,744,761</b>	<b>1.07%</b>
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	520,744,761	1.07%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>6,532,301,089</b>	<b>13.38%</b>
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,402,508,702	2.87%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	1,074,715,554	2.20%
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	1,001,699,090	2.05%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	997,521,740	2.04%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	699,980,015	1.43%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	601,509,378	1.23%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	503,182,420	1.03%

LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	251,184,190	0.52%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>48,807,322,857</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>49,913,923,642</b>	

**Cartera al:** 30/08/2024

**Límite Máximo de VaR: 0.134 % Var Promedio: 0.037 %**  
**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."**