

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			50,959,262	1.65%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	50,959,262	1.65%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			658,243,190	21.28%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	177,649,960	5.74%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	170,072,620	5.50%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	144,416,265	4.67%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	48,727,045	1.58%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	47,370,915	1.53%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	47,201,080	1.53%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	22,805,305	0.74%
	Chequera Dolares			125,742	0.00%
CHD	40-133	8031130		125,742	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			241,732,940	7.82%
93	START	02724	HR+1	36,449,822	1.18%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	24,475,846	0.79%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	19,644,116	0.64%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,517,620	0.63%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,026,916	0.62%
93	START	02624	HR+1	18,060,943	0.58%
93	START	02824	HR+1	17,775,339	0.58%
93	START	02124	HR+1	17,058,056	0.55%
93	START	02224	HR+1	12,014,764	0.39%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	10,683,540	0.35%
93	START	02324	HR+1	10,078,569	0.33%
93	START	01724	HR+1	10,057,229	0.33%
93	GMFIN	05324	F1+ (mex)	9,990,887	0.32%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,821,782	0.32%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,621,797	0.15%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,455,715	0.08%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			186,505,149	6.03%

I	BANREG	25175	F1+ (mex)	83,094,158	2.69%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	52,886,196	1.71%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	50,524,795	1.63%
	Reportos			994,573,010	32.16%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	443,592,023	14.34%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	293,928,243	9.50%
LD	BONDES	251211	AAA(mex)	257,052,744	8.31%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			960,697,313	31.06%
LF	BONDES	270225	AAA(mex)	500,726,740	16.19%
LF	BONDES	270318	AAA(mex)	100,339,652	3.24%
LF	BONDES	270422	AAA(mex)	100,086,092	3.24%
LF	BONDES	281228	AAA(mex)	99,858,311	3.23%
LF	BONDES	270819	AAA(mex)	99,812,241	3.23%
LF	BONDES	270722	AAA(mex)	49,902,411	1.61%
LF	BONDES	290419	AAA(mex)	9,971,867	0.32%
	TOTAL CARTERA			3,092,836,606	100.00%
	ACTIVO NETO			3,117,677,403	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.015 %
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."