

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			51,468,287	1.43%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,468,287	1.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			667,084,660	18.52%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	180,324,360	5.01%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	173,172,820	4.81%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	145,805,895	4.05%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	49,180,310	1.37%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	47,852,310	1.33%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	47,672,370	1.32%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,076,595	0.64%
	Chequera Dolares			125,674	0.00%
CHD	40-133	8031130		125,674	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			257,507,339	7.15%
93	START	02724	HR+1	36,465,514	1.01%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	24,696,388	0.69%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	19,826,562	0.55%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,709,429	0.55%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,198,745	0.53%
93	START	02624	HR+1	18,073,288	0.50%
93	START	02824	HR+1	17,783,090	0.49%
93	START	02124	HR+1	17,073,139	0.47%
93	START	02224	HR+1	12,026,023	0.33%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	10,787,634	0.30%
93	START	03324	HR+1	10,083,232	0.28%
93	START	02324	HR+1	10,082,973	0.28%
93	START	01724	HR+1	10,062,926	0.28%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,916,210	0.28%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,545,351	0.27%
93	START	03424	HR+1	5,030,690	0.14%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,666,285	0.13%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,479,859	0.07%

	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			188,484,890	5.23%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	83,950,143	2.33%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	53,391,812	1.48%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	51,142,935	1.42%
	Reportos			1,126,723,941	31.29%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	434,791,870	12.07%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	357,027,545	9.91%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	334,904,526	9.30%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,310,145,491	36.38%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	501,064,325	13.91%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	199,240,970	5.53%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,779,245	3.05%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,404,919	2.79%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,158,740	2.78%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,924,189	2.77%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,873,567	2.77%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,943,241	1.39%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,756,296	1.38%
	TOTAL CARTERA			3,601,540,282	100.00%
	ACTIVO NETO			3,645,754,893	

Cartera al: 30/09/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.012 %

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."