

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>192,856,056</b>	<b>5.08%</b>
M	BONOS	260903	AAA(mex)	192,856,056	5.08%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>90,060,340</b>	<b>2.37%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	90,060,340	2.37%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>185,920,209</b>	<b>4.90%</b>
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	62,483,082	1.65%
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	59,212,184	1.56%
94	BLADEX	23	AAA (mex)	34,799,859	0.92%
94	BACTIN	23	AA (mex)	29,425,083	0.78%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,195,767,613</b>	<b>57.81%</b>
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	190,896,458	5.03%
91	LALA	19-2	AA (mex)	151,286,558	3.98%
91	AB&CCB	22	AAA (mex)	124,199,513	3.27%
91	CIRCLEK	22	HR A+	119,895,895	3.16%
91	DONDE	23	HR AA	100,856,093	2.66%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	100,686,558	2.65%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	100,682,051	2.65%
91	VOLARCB	23	HR AA+	100,671,064	2.65%
91	ARA	23X	mxAA-	100,547,465	2.65%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	100,288,789	2.64%
91	PCARFM	24	AAA (mex)	100,218,760	2.64%
91	VIVAACB	22L	AA+/M	91,271,298	2.40%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	90,898,095	2.39%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	80,558,114	2.12%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	75,322,490	1.98%
91	VINTE	23X	HR AA-	75,110,278	1.98%
91	TPLAY	22	HR A	74,876,713	1.97%
91	SALUD	20	HR A+	74,395,433	1.96%
91	SALUD	21	HR A+	50,325,887	1.33%
91	BEGRAND	23	A+/M	40,352,991	1.06%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	40,120,142	1.06%

91	DAIMLER	23	mxAAA	40,106,403	1.06%
91	ENGENCB	24	AAA (mex)	37,183,493	0.98%
91	TPLAYCB	20	HR AA	37,118,681	0.98%
91	GASA	24	HR AA+	20,147,416	0.53%
91	HYCSA	24	HR AA	20,110,791	0.53%
91	CYDSASA	23	HR AA+	20,045,652	0.53%
91	FUTILCB	24S	mxAAA	19,990,439	0.53%
91	STORAGE	21-2V	AA- (mex)	17,604,095	0.46%

<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>550,109,510</b>	<b>14.48%</b>
--	--	--	--	--------------------	---------------

BI	CETES	251224	AAA(mex)	290,388,573	7.65%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	151,182,800	3.98%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	108,538,138	2.86%

<b>Chequera Dolares</b>				<b>185,750</b>	<b>0.01%</b>
-------------------------	--	--	--	----------------	--------------

CHD	40-133	8355257		185,750	0.01%
-----	--------	---------	--	---------	-------

<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>105,565,741</b>	<b>2.78%</b>
--	--	--	--	--------------------	--------------

93	ELEKTRA	00124	HR1	100,564,103	2.65%
93	AUTLAN	00224	F2 (mex)	5,001,638	0.13%

<b>Swaps Entregables</b>				<b>-9,886,950</b>	<b>-0.26%</b>
--------------------------	--	--	--	-------------------	---------------

SWP	2TIEMXP	260218		-53,750	0.00%
SWP	2TIEMXP	261005		-8,242,000	-0.22%
SWP	2TIEMXP	261006		-1,754,000	-0.05%
SWP	2TIEMXP	261015		-352,500	-0.01%
SWP	2TIEMXP	250207		432,000	0.01%
SWP	2TIEMXP	241111		83,300	0.00%

<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>				<b>124,439,443</b>	<b>3.28%</b>
---	--	--	--	--------------------	--------------

JI	CABEI	1-23S	mxAAA	124,439,443	3.28%
----	-------	-------	-------	-------------	-------

<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>				<b>91,398,958</b>	<b>2.41%</b>
--	--	--	--	-------------------	--------------

95	CFE	23-2X	AAA (mex)	91,398,958	2.41%
----	-----	-------	-----------	------------	-------

<b>Reportos</b>				<b>271,614,178</b>	<b>7.15%</b>
-----------------	--	--	--	--------------------	--------------

BI	CETES	250821	AAA(mex)	271,614,178	7.15%
----	-------	--------	----------	-------------	-------

<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>3,798,030,848</b>	<b>100.00%</b>
----------------------	--	--	--	----------------------	----------------

<b>ACTIVO NETO</b>				<b>3,824,801,386</b>	
--------------------	--	--	--	----------------------	--

**Cartera al: 07/11/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.270 % Var Promedio: 0.141 %**

**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."**