

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			51,948,741	1.49%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,948,741	1.49%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			669,588,113	19.18%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	180,638,140	5.18%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	172,826,540	4.95%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	147,032,670	4.21%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	49,619,170	1.42%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,237,975	1.38%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	48,041,305	1.38%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,192,313	0.66%
	Chequera Dolares			127,709	0.00%
CHD	40-133	8031130		127,709	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			253,799,490	7.27%
93	START	04124	HR+1	26,007,947	0.75%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	24,914,253	0.71%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,881,954	0.57%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,372,128	0.56%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,070,558	0.55%
93	START	02624	HR+1	18,084,697	0.52%
93	START	02824	HR+1	17,645,739	0.51%
93	START	02124	HR+1	17,079,139	0.49%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	16,879,883	0.48%
93	START	02224	HR+1	12,030,616	0.35%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	10,883,479	0.31%
93	START	01724	HR+1	10,066,405	0.29%
93	START	02324	HR+1	10,004,717	0.29%
93	START	03324	HR+1	10,003,084	0.29%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,632,108	0.28%
93	START	03424	HR+1	5,032,814	0.14%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,708,069	0.14%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,501,898	0.07%

	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			290,180,359	8.31%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	100,346,421	2.88%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	84,595,408	2.42%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	53,848,716	1.54%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	51,389,813	1.47%
	Reportos			915,094,182	26.21%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	558,171,504	15.99%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	356,922,678	10.22%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,310,166,834	37.53%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	501,359,340	14.36%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	199,410,674	5.71%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,851,616	3.15%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,218,470	2.87%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,978,546	2.86%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,938,511	2.86%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,640,437	2.85%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,976,348	1.43%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,792,893	1.43%
	TOTAL CARTERA			3,490,905,428	100.00%
	ACTIVO NETO			3,484,497,574	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.011 %
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."