

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			51,329,846	1.31%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,329,846	1.31%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			630,981,880	16.14%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	184,089,240	4.71%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	176,346,220	4.51%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	149,173,875	3.82%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,964,245	1.25%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	48,799,080	1.25%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,609,220	0.60%
	Chequera Dolares			129,539	0.00%
CHD	40-133	8031130		129,539	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			364,603,004	9.33%
93	START	05024	HR+1	59,525,600	1.52%
93	START	04824	HR+1	49,088,484	1.26%
93	START	04924	HR+1	30,008,538	0.77%
93	START	04124	HR+1	26,166,810	0.67%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,320,874	0.65%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,687,863	0.50%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,371,934	0.50%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	19,144,790	0.49%
93	START	02624	HR+1	18,037,792	0.46%
93	START	02824	HR+1	17,752,178	0.45%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,146,298	0.44%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	11,050,142	0.28%
93	START	03324	HR+1	10,066,469	0.26%
93	START	02324	HR+1	10,065,554	0.26%
93	START	04324	HR+1	10,044,120	0.26%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,783,164	0.25%
93	START	04724	HR+1	5,021,852	0.13%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,780,939	0.12%
93	GMFIN	07524	F1+ (mex)	2,539,602	0.07%

	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			291,388,104	7.45%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	102,264,444	2.62%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	85,958,942	2.20%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	52,346,868	1.34%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	50,817,849	1.30%
	Reportos			1,063,106,617	27.19%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	736,195,692	18.83%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	326,910,925	8.36%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,508,517,731	38.58%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	500,364,580	12.80%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	199,059,042	5.09%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,628,347	2.80%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,261,961	2.56%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	100,153,503	2.56%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,026,796	2.56%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	99,877,972	2.55%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,775,245	2.55%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,770,407	2.55%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,895,882	1.28%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,703,996	1.27%
	TOTAL CARTERA			3,910,056,721	100.00%
	ACTIVO NETO			3,941,017,303	

Cartera al: 19/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.009 %

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."