

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 | | | 51,049,472 | 1.39% |
| IQ | BPAG91 | 290510 | AAA(mex) | 51,049,472 | 1.39% |
| | Certificados De La Tesorería De La Federación | | | 627,323,325 | 17.05% |
| BI | CETES | 251030 | AAA(mex) | 182,929,400 | 4.97% |
| BI | CETES | 260416 | AAA(mex) | 175,289,100 | 4.76% |
| BI | CETES | 250109 | AAA(mex) | 148,419,675 | 4.03% |
| BI | CETES | 250306 | AAA(mex) | 48,709,075 | 1.32% |
| BI | CETES | 250320 | AAA(mex) | 48,520,000 | 1.32% |
| BI | CETES | 250724 | AAA(mex) | 23,456,075 | 0.64% |
| | Chequera Dolares | | | 129,944 | 0.00% |
| CHD | 40-133 | 8031130 | | 129,944 | 0.00% |
| | Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial | | | 254,160,560 | 6.91% |
| 93 | START | 04124 | HR+1 | 26,030,457 | 0.71% |
| 93 | VWLEASE | 09324 | mxA-1+ | 25,184,041 | 0.68% |
| 93 | VWLEASE | 07824 | mxA-1+ | 19,578,139 | 0.53% |
| 93 | GMFIN | 11424 | F1+ (mex) | 19,257,510 | 0.52% |
| 93 | GMFIN | 13224 | F1+ (mex) | 19,023,901 | 0.52% |
| 93 | START | 02624 | HR+1 | 18,100,141 | 0.49% |
| 93 | START | 02824 | HR+1 | 17,659,673 | 0.48% |
| 93 | START | 02124 | HR+1 | 17,094,164 | 0.46% |
| 93 | GMFIN | 11124 | F1+ (mex) | 17,046,019 | 0.46% |
| 93 | START | 02224 | HR+1 | 12,039,382 | 0.33% |
| 93 | GMFIN | 08424 | F1+ (mex) | 10,992,517 | 0.30% |
| 93 | START | 04324 | HR+1 | 10,075,231 | 0.27% |
| 93 | START | 03324 | HR+1 | 10,014,013 | 0.27% |
| 93 | START | 02324 | HR+1 | 10,012,910 | 0.27% |
| 93 | GMFIN | 09924 | F1+ (mex) | 9,732,680 | 0.26% |
| 93 | START | 03424 | HR+1 | 5,037,269 | 0.14% |
| 93 | GMFIN | 09024 | F1+ (mex) | 4,756,300 | 0.13% |
| 93 | GMFIN | 07524 | F1+ (mex) | 2,526,213 | 0.07% |

| | | | | | |
|----|---|--------|-----------|----------------------|----------------|
| | Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs) | | | 289,654,431 | 7.87% |
| I | BANREG | 25344 | F1+ (mex) | 101,627,873 | 2.76% |
| I | BANREG | 25175 | F1+ (mex) | 85,488,029 | 2.32% |
| I | BANREG | 25304 | F1+ (mex) | 52,041,522 | 1.41% |
| I | BANREG | 25444 | F1+ (mex) | 50,497,006 | 1.37% |
| | Reportos | | | 1,146,660,583 | 31.16% |
| BI | CETES | 250320 | AAA(mex) | 1,119,819,590 | 30.43% |
| M | BONOS | 330526 | AAA(mex) | 26,840,993 | 0.73% |
| | Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal | | | 1,311,326,756 | 35.63% |
| LF | BONDESF | 270225 | AAA(mex) | 501,810,795 | 13.64% |
| LF | BONDESF | 270923 | AAA(mex) | 199,571,122 | 5.42% |
| LF | BONDESF | 290419 | AAA(mex) | 109,948,467 | 2.99% |
| LF | BONDESF | 270422 | AAA(mex) | 100,315,808 | 2.73% |
| LF | BONDESF | 281228 | AAA(mex) | 100,066,306 | 2.72% |
| LF | BONDESF | 270819 | AAA(mex) | 100,025,396 | 2.72% |
| LF | BONDESF | 270318 | AAA(mex) | 99,738,232 | 2.71% |
| LF | BONDESF | 270722 | AAA(mex) | 50,020,465 | 1.36% |
| LF | BONDESF | 290719 | AAA(mex) | 49,830,166 | 1.35% |
| | TOTAL CARTERA | | | 3,680,305,071 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 3,693,076,065 | |

Cartera al: 29/11/2024

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."