

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/1CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			30,056,580	0.80%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,560,111	0.55%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,496,469	0.25%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,410,509	2.62%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,189,796	2.00%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,220,714	0.62%
	Certificados Bursátiles Bancarios			593,850,515	15.79%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	282,545,359	7.51%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,554,405	4.00%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,537,023	2.67%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,188,692	0.94%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,025,036	0.67%
	Certificados Bursátiles Corporativos			396,741,863	10.55%
91	LALA	19-2	AA (mex)	188,214,130	5.01%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	68,682,620	1.83%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,178,000	0.80%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,172,370	0.80%
91	LAB	23	AA (mex)	30,033,651	0.80%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	29,358,889	0.78%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,102,204	0.54%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,704,993	0.44%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,704,993	0.44%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,284,505,379	34.16%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	282,186,510	7.50%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	254,835,559	6.78%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	186,698,320	4.96%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	99,617,930	2.65%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	96,878,280	2.58%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	96,489,020	2.57%

BI	CETES	250306	AAA(mex)	95,389,400	2.54%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	88,530,450	2.35%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	83,879,910	2.23%
	Chequera Dolares			20,963,770	0.56%
CHD	40-133	8032674		20,963,770	0.56%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			223,828,756	5.95%
93	TPLAY	00223	HR2	40,314,446	1.07%
93	TPLAY	00124	HR2	35,107,690	0.93%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,244,018	0.80%
93	AMX	08824	F1+ (mex)	28,950,442	0.77%
93	MINSA	00124	HR2	15,108,314	0.40%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,038,583	0.40%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,969,497	0.37%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,329,166	0.28%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,025,766	0.27%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,025,325	0.27%
93	AMX	07124	F1+ (mex)	7,560,922	0.20%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	7,154,587	0.19%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			120,545,852	3.21%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,545,852	3.21%
	Reportos			975,186,684	25.93%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	436,764,373	11.61%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	215,539,171	5.73%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	200,059,699	5.32%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	62,917,784	1.67%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	59,905,657	1.59%
	TOTAL CARTERA			3,760,794,901	100.00%
	ACTIVO NETO			3,751,094,066	

Cartera al: 19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % 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."