

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			132,157,249	3.46%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	102,534,977	2.69%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,141,940	0.53%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,480,332	0.25%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,862,455	2.59%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,690,707	1.98%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,171,748	0.61%
	Certificados Bursátiles Bancarios			593,074,240	15.54%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	282,070,085	7.39%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,253,431	3.94%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,341,705	2.63%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,113,024	0.92%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,295,994	0.66%
	Certificados Bursátiles Corporativos			422,810,076	11.08%
91	LALA	19-2	AA (mex)	189,576,460	4.97%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	69,175,656	1.81%
91	LAB	23	AA (mex)	30,237,677	0.79%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,115,092	0.79%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,093,326	0.79%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	29,569,257	0.78%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,983,840	0.63%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,058,769	0.53%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,815,224	0.44%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,815,224	0.44%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			923,641,840	24.19%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	275,382,810	7.21%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	182,073,040	4.77%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	97,700,310	2.56%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,851,490	2.49%

BI	CETES	250123	AAA(mex)	94,451,520	2.47%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	93,305,540	2.44%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	85,877,130	2.25%
	Chequera Dolares			55,502,295	1.45%
CHD	40-133	8032674		55,502,295	1.45%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			254,621,600	6.67%
93	TPLAY	00223	HR2	40,222,937	1.05%
93	TPLAY	00124	HR2	35,018,393	0.92%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,175,855	0.79%
93	AMX	08824	F1+ (mex)	28,362,883	0.74%
93	DONDE	00124	HR1	20,053,500	0.53%
93	MINSA	00124	HR2	15,077,267	0.40%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,004,964	0.39%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,940,739	0.37%
93	FINBE	00924	HR1	12,027,073	0.32%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,307,942	0.27%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,003,315	0.26%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,003,260	0.26%
93	AMX	07124	F1+ (mex)	7,410,445	0.19%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	7,013,027	0.18%
	Udibonos			234,759,986	6.15%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	234,759,986	6.15%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			158,987,263	4.16%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,289,568	3.15%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	38,697,694	1.01%
	Reportos			926,486,276	24.27%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	888,212,989	23.27%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,793,734	0.60%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	15,479,553	0.41%
	TOTAL CARTERA			3,817,718,504	100.00%
	ACTIVO NETO			3,808,387,144	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.017 %
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."