

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			794,393,843	37.11%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	347,115,195	16.21%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	246,319,380	11.51%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	191,443,236	8.94%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,516,032	0.44%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,073,625,620	50.15%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	281,942,130	13.17%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	229,616,075	10.73%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	189,469,380	8.85%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	97,636,420	4.56%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,249,100	4.54%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,055,410	2.25%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	44,452,170	2.08%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,187,630	2.02%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,017,305	1.96%
	Udibonos			50,006,906	2.34%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,006,906	2.34%
	Reportos			222,852,097	10.41%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	222,852,097	10.41%
	TOTAL CARTERA			2,140,878,466	100.00%
	ACTIVO NETO			1,845,906,465	
	Cartera al:		17/10/2024		

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.028 %

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."