

CORTO 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 Mensual I			100,245,627	1.48%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	100,245,627	1.48%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,054,731,898	15.57%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	219,805,925	3.24%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	188,314,187	2.78%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	157,127,064	2.32%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	142,053,255	2.10%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	97,548,420	1.44%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	92,065,870	1.36%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	84,786,100	1.25%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	49,528,150	0.73%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,502,928	0.35%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			386,028,424	5.70%
93	START	03924	HR+1	64,530,458	0.95%
93	START	04124	HR+1	37,613,351	0.56%
93	START	03624	HR+1	35,891,837	0.53%
93	START	04424	HR+1	31,483,803	0.47%
93	START	04724	HR+1	29,676,636	0.44%
93	START	02124	HR+1	27,181,254	0.40%
93	START	04524	HR+1	22,819,283	0.34%
93	START	03724	HR+1	21,677,870	0.32%
93	START	04324	HR+1	20,006,147	0.30%
93	START	02624	HR+1	18,121,225	0.27%
93	START	03024	HR+1	18,008,249	0.27%
93	START	02824	HR+1	17,680,299	0.26%
93	START	02224	HR+1	13,057,908	0.19%
93	START	03324	HR+1	12,030,919	0.18%
93	START	02324	HR+1	10,024,759	0.15%
93	START	03824	HR+1	6,224,426	0.09%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			774,781,416	11.44%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	208,443,312	3.08%

I	BANREG	25344	F1+ (mex)	203,548,993	3.00%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	202,425,181	2.99%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	160,363,929	2.37%
	Reportos			2,350,377,937	34.69%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	1,905,599,618	28.13%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	350,336,825	5.17%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	94,441,494	1.39%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			2,108,738,166	31.13%
LF	BONDESF	251016	AAA(mex)	553,053,787	8.16%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	552,441,776	8.15%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	301,155,369	4.45%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	300,747,087	4.44%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	201,218,384	2.97%
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	100,372,235	1.48%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	99,749,528	1.47%
	TOTAL CARTERA			6,774,903,468	100.00%
	ACTIVO NETO			6,769,413,029	

Cartera al: 05/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.010 %

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."