

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/2CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Mensual De Inte</b>			<b>100,228,568</b>	<b>1.82%</b>
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	100,228,568	1.82%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>1,299,273,687</b>	<b>23.57%</b>
BI	CETES	241128	AAA(mex)	393,798,891	7.14%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	208,366,325	3.78%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	150,083,631	2.72%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	135,402,000	2.46%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	98,965,680	1.80%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	98,121,470	1.78%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	93,305,540	1.69%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	48,850,155	0.89%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	47,425,745	0.86%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,954,250	0.45%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>261,532,395</b>	<b>4.74%</b>
93	START	02424	HR+1	55,017,324	1.00%
93	START	01324	HR+1	33,951,466	0.62%
93	START	01824	HR+1	32,025,175	0.58%
93	START	02124	HR+1	27,188,175	0.49%
93	START	01924	HR+1	22,294,264	0.40%
93	START	01724	HR+1	20,006,355	0.36%
93	START	00724	HR+1	18,125,047	0.33%
93	START	00924	HR+1	18,007,058	0.33%
93	START	02224	HR+1	13,061,378	0.24%
93	START	01124	HR+1	11,831,258	0.22%
93	START	02324	HR+1	10,024,895	0.18%
	<b>Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)</b>			<b>573,324,588</b>	<b>10.40%</b>
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	210,334,854	3.82%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	209,957,238	3.81%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	153,032,496	2.78%
	<b>Reportos</b>			<b>1,623,292,335</b>	<b>29.45%</b>

IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,359,780,138	24.67%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	163,243,003	2.96%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	100,269,195	1.82%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>1,655,068,738</b>	<b>30.02%</b>
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	552,427,985	10.02%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	300,664,761	5.45%
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	300,074,793	5.44%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	201,236,418	3.65%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,438,905	1.82%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	100,218,146	1.82%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,007,730	1.81%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>5,512,720,311</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>5,508,505,019</b>	

**Cartera al: 18/07/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.009 %**  
**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."**