

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			100,451,038	1.53%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	100,451,038	1.53%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,310,996,415	19.95%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	401,872,119	6.12%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	215,376,450	3.28%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	184,306,393	2.81%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	153,791,648	2.34%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	139,011,090	2.12%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	95,389,400	1.45%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	49,808,965	0.76%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	48,439,140	0.74%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,001,210	0.35%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			347,326,739	5.29%
93	START	02424	HR+1	55,134,430	0.84%
93	START	02724	HR+1	36,333,074	0.55%
93	START	03624	HR+1	35,666,303	0.54%
93	START	03124	HR+1	32,090,373	0.49%
93	START	03424	HR+1	29,740,113	0.45%
93	START	02124	HR+1	27,009,037	0.41%
93	START	01924	HR+1	22,343,854	0.34%
93	START	01724	HR+1	20,051,963	0.31%
93	START	03024	HR+1	18,044,393	0.28%
93	START	02624	HR+1	18,005,616	0.27%
93	START	02824	HR+1	17,717,817	0.27%
93	START	02224	HR+1	13,088,221	0.20%
93	START	03324	HR+1	12,055,534	0.18%
93	START	02324	HR+1	10,046,011	0.15%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			575,322,754	8.75%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	214,610,345	3.27%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	203,913,918	3.10%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	156,798,492	2.39%

	Reportos			2,479,079,535	37.72%
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	837,709,020	12.75%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	547,324,217	8.33%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	498,540,198	7.59%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	177,501,777	2.70%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	153,123,432	2.33%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	145,724,128	2.22%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	119,156,764	1.81%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,758,571,378	26.76%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	553,597,491	8.42%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	301,777,101	4.59%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	301,327,758	4.59%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	199,972,580	3.04%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,652,827	1.53%
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	100,580,699	1.53%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	100,433,783	1.53%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,229,139	1.53%
	TOTAL CARTERA			6,571,747,859	100.00%
	ACTIVO NETO			6,566,650,510	

Cartera al: 19/09/2024

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."