

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			100,465,449	1.49%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	100,465,449	1.49%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,359,799,236	20.15%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	405,177,826	6.01%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	215,938,150	3.20%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	185,330,482	2.75%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	154,891,218	2.30%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	139,894,875	2.07%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	96,110,820	1.42%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	90,500,400	1.34%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	48,818,210	0.72%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,137,255	0.34%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			384,815,707	5.70%
93	START	03924	HR+1	64,663,424	0.96%
93	START	02724	HR+1	36,328,736	0.54%
93	START	03624	HR+1	35,665,689	0.53%
93	START	03124	HR+1	32,089,976	0.48%
93	START	03424	HR+1	29,738,196	0.44%
93	START	02124	HR+1	27,012,905	0.40%
93	START	01924	HR+1	22,341,884	0.33%
93	START	03724	HR+1	21,728,284	0.32%
93	START	01724	HR+1	20,049,138	0.30%
93	START	03024	HR+1	18,043,230	0.27%
93	START	02624	HR+1	18,009,414	0.27%
93	START	02824	HR+1	17,715,702	0.26%
93	START	02224	HR+1	13,090,269	0.19%
93	START	03324	HR+1	12,054,094	0.18%
93	START	02324	HR+1	10,047,090	0.15%
93	START	03824	HR+1	6,237,675	0.09%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			779,627,123	11.55%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	216,323,675	3.21%

I	BANREG	25304	F1+ (mex)	205,087,061	3.04%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	200,211,533	2.97%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	158,004,854	2.34%
	Reportos			2,364,514,633	35.04%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	863,444,951	12.80%
LF	BONDES F	261001	AAA(mex)	568,494,781	8.43%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	523,438,048	7.76%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	277,189,621	4.11%
LD	BONDES D	251211	AAA(mex)	131,947,231	1.96%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,758,508,359	26.06%
LF	BONDES F	250116	AAA(mex)	553,548,428	8.20%
LF	BONDES F	250703	AAA(mex)	301,757,244	4.47%
LF	BONDES F	260604	AAA(mex)	301,343,460	4.47%
LF	BONDES F	250403	AAA(mex)	199,983,298	2.96%
LF	BONDES F	241024	AAA(mex)	100,644,059	1.49%
LF	BONDES F	250828	AAA(mex)	100,572,983	1.49%
LF	BONDES F	241128	AAA(mex)	100,429,729	1.49%
LF	BONDES F	241107	AAA(mex)	100,229,158	1.49%
	TOTAL CARTERA			6,747,730,507	100.00%
	ACTIVO NETO			6,742,941,831	

Cartera al: 17/10/2024

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."