

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/3CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>355,099,585</b>	<b>17.94%</b>
M	BONOS	241205	AAA(mex)	345,557,930	17.45%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,541,654	0.48%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>1,070,685,290</b>	<b>54.08%</b>
BI	CETES	250529	AAA(mex)	281,046,630	14.20%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	229,125,950	11.57%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	188,715,980	9.53%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	97,203,930	4.91%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	96,821,090	4.89%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	47,852,310	2.42%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	44,480,835	2.25%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,293,205	2.19%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,145,360	2.13%
	<b>Udibonos</b>			<b>49,981,786</b>	<b>2.53%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	49,981,786	2.53%
	<b>Reportos</b>			<b>504,101,563</b>	<b>25.46%</b>
IS	BPA182	290927	AAA(mex)	504,101,563	25.46%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,979,868,224</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,979,395,840</b>	

Cartera al: 30/09/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.023 %

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."**