

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 De Inte			99,904,764	1.60%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	99,904,764	1.60%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,307,888,818	20.94%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	399,561,769	6.40%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	212,590,775	3.40%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	152,632,564	2.44%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	137,875,170	2.21%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	99,492,510	1.59%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	94,741,830	1.52%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	90,505,360	1.45%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	49,544,780	0.79%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	48,138,755	0.77%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	22,805,305	0.37%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			315,846,731	5.06%
93	START	02424	HR+1	55,302,075	0.89%
93	START	02724	HR+1	36,449,822	0.58%
93	START	01324	HR+1	33,828,023	0.54%
93	START	03124	HR+1	31,914,866	0.51%
93	START	02124	HR+1	27,092,207	0.43%
93	START	01924	HR+1	22,221,652	0.36%
93	START	01724	HR+1	20,114,458	0.32%
93	START	03024	HR+1	18,099,758	0.29%
93	START	02624	HR+1	18,060,943	0.29%
93	START	02824	HR+1	17,775,239	0.29%
93	START	02224	HR+1	13,015,994	0.21%
93	START	01124	HR+1	11,893,126	0.19%
93	START	02324	HR+1	10,078,569	0.16%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			571,103,077	9.14%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	213,327,197	3.42%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	202,099,181	3.24%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	155,676,699	2.49%

	Reportos			2,199,029,706	35.21%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	1,434,900,871	22.97%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	273,237,160	4.37%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	202,473,625	3.24%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	188,087,569	3.01%
LD	BONDES	251211	AAA(mex)	100,330,481	1.61%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,752,391,325	28.06%
LF	BONDES	250116	AAA(mex)	550,605,536	8.82%
LF	BONDES	250703	AAA(mex)	300,144,267	4.81%
LF	BONDES	260604	AAA(mex)	299,678,001	4.80%
LF	BONDES	250403	AAA(mex)	200,564,454	3.21%
LF	BONDES	241128	AAA(mex)	100,733,092	1.61%
LF	BONDES	241107	AAA(mex)	100,525,827	1.61%
LF	BONDES	241024	AAA(mex)	100,108,840	1.60%
LF	BONDES	250828	AAA(mex)	100,031,308	1.60%
	TOTAL CARTERA			6,246,164,421	100.00%
	ACTIVO NETO			6,242,179,515	

Cartera al: 30/08/2024

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."