

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			99,990,433	1.49%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	99,990,433	1.49%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,315,773,757	19.55%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	403,278,542	5.99%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	216,466,025	3.22%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	184,934,886	2.75%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	154,275,314	2.29%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	139,450,530	2.07%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	95,704,620	1.42%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	49,985,280	0.74%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	48,601,965	0.72%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,076,595	0.34%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			369,672,925	5.49%
93	START	02424	HR+1	55,337,592	0.82%
93	START	02724	HR+1	36,465,514	0.54%
93	START	03624	HR+1	35,800,326	0.53%
93	START	03124	HR+1	31,937,798	0.48%
93	START	03424	HR+1	29,849,701	0.44%
93	START	02124	HR+1	27,116,163	0.40%
93	START	01924	HR+1	22,235,934	0.33%
93	START	03724	HR+1	21,625,244	0.32%
93	START	01724	HR+1	20,125,852	0.30%
93	START	03024	HR+1	18,111,482	0.27%
93	START	02624	HR+1	18,073,288	0.27%
93	START	02824	HR+1	17,782,989	0.26%
93	START	02224	HR+1	13,028,192	0.19%
93	START	03324	HR+1	12,099,878	0.18%
93	START	02324	HR+1	10,082,973	0.15%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRL			577,221,449	8.58%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	215,366,699	3.20%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	204,571,740	3.04%

I	BANREG	25181	F1+ (mex)	157,283,009	2.34%
	Reportos			2,613,362,317	38.83%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	1,049,012,236	15.59%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	700,650,968	10.41%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	500,061,440	7.43%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	298,365,746	4.43%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	65,271,927	0.97%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,753,542,882	26.06%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	550,951,247	8.19%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	300,334,626	4.46%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	299,910,972	4.46%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	200,691,524	2.98%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	100,794,151	1.50%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,589,173	1.50%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,171,849	1.49%
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	100,099,340	1.49%
	TOTAL CARTERA			6,729,563,763	100.00%
	ACTIVO NETO			6,725,188,200	

Cartera al: **30/09/2024**

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."