

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			480,776,577	12.52%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	247,835,625	6.45%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	202,498,859	5.27%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,851,250	0.54%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,590,842	0.25%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,785,887	2.57%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,618,036	1.97%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,167,851	0.60%
	Certificados Bursátiles Bancarios			592,614,974	15.43%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	281,813,506	7.34%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,208,467	3.91%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,289,991	2.61%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,108,219	0.91%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,194,791	0.66%
	Certificados Bursátiles Corporativos			433,804,796	11.29%
91	LALA	19-2	AA (mex)	189,377,487	4.93%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	69,145,346	1.80%
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	35,247,104	0.92%
91	LAB	23	AA (mex)	30,231,488	0.79%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,109,239	0.78%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,090,106	0.78%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	29,546,269	0.77%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,057,758	0.52%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,198,755,139	31.21%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	285,681,120	7.44%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	257,554,749	6.71%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	188,978,500	4.92%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	98,223,790	2.56%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,831,400	2.55%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	96,681,970	2.52%

BI	CETES	251224	AAA(mex)	89,350,330	2.33%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	84,453,280	2.20%
	Chequera Dolares			1,733,511	0.05%
CHD	40-133	8032674		1,733,511	0.05%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			217,503,537	5.66%
93	AMX	13024	F1+ (mex)	36,465,612	0.95%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,169,231	0.79%
93	AMX	08824	F1+ (mex)	29,393,104	0.77%
93	AMX	13324	F1+ (mex)	17,177,611	0.45%
93	PCARFM	04224	F1+ (mex)	15,156,914	0.40%
93	MINSA	00124	HR2	15,074,899	0.39%
93	FINBE	01524	HR1	15,069,590	0.39%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,004,823	0.39%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,305,252	0.27%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,003,221	0.26%
93	AMX	13924	F1+ (mex)	9,133,179	0.24%
93	AMX	07124	F1+ (mex)	7,674,238	0.20%
93	TOYOTA	10224	F1+ (mex)	6,875,862	0.18%
	Udibonos			70,337,793	1.83%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	70,337,793	1.83%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			120,275,540	3.13%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,275,540	3.13%
	Reportos			626,748,915	16.32%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	378,415,050	9.85%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	115,508,419	3.01%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	100,029,106	2.60%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	32,796,340	0.85%
	TOTAL CARTERA			3,841,336,669	100.00%
	ACTIVO NETO			3,837,675,833	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.020 %
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."