

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 | | | 481,811,902 | 12.17% |
| M | BONOS | 250306 | AAA(mex) | 248,432,803 | 6.28% |
| M | BONOS | 260903 | AAA(mex) | 202,879,963 | 5.13% |
| M | BONOS | 241205 | AAA(mex) | 20,892,579 | 0.53% |
| M | BONOS | 260305 | AAA(mex) | 9,606,558 | 0.24% |
| | Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo | | | 98,363,653 | 2.49% |
| CD | NAFR | 22S | AAA (mex) | 75,147,535 | 1.90% |
| CD | BANOB | 23 | AAA (mex) | 23,216,119 | 0.59% |
| | Certificados Bursátiles Bancarios | | | 593,688,300 | 15.00% |
| 94 | BACTIN | 21-2 | AA (mex) | 282,431,175 | 7.14% |
| 94 | BACTIN | 22 | AA (mex) | 150,544,821 | 3.80% |
| 94 | BACTIN | 23 | AA (mex) | 100,504,907 | 2.54% |
| 94 | BLADEX | 24 | AAA (mex) | 35,183,765 | 0.89% |
| 94 | BMIFEL | 23V | AA (mex) | 25,023,631 | 0.63% |
| | Certificados Bursátiles Corporativos | | | 431,669,104 | 10.91% |
| 91 | LALA | 19-2 | AA (mex) | 188,138,337 | 4.75% |
| 91 | FUNO | 21-2X | AAA (mex) | 68,676,542 | 1.74% |
| 91 | HERDEZ | 22-2L | AA (mex) | 35,021,458 | 0.89% |
| 91 | GCARSO | 23 | AAA (mex) | 30,173,037 | 0.76% |
| 91 | BRX | 22-2 | AAA (mex) | 30,168,801 | 0.76% |
| 91 | LAB | 23 | AA (mex) | 30,032,193 | 0.76% |
| 91 | GCARSO | 24 | AAA (mex) | 29,358,477 | 0.74% |
| 91 | FERROMX | 21-2 | AAA (mex) | 20,100,258 | 0.51% |
| | Certificados De La Tesorería De La Federación | | | 1,201,662,294 | 30.36% |
| BI | CETES | 250430 | AAA(mex) | 286,358,040 | 7.24% |
| BI | CETES | 250821 | AAA(mex) | 258,208,334 | 6.52% |
| BI | CETES | 250529 | AAA(mex) | 189,364,300 | 4.79% |
| BI | CETES | 250109 | AAA(mex) | 98,450,770 | 2.49% |
| BI | CETES | 250123 | AAA(mex) | 98,064,050 | 2.48% |
| BI | CETES | 250306 | AAA(mex) | 96,913,540 | 2.45% |

| | | | | | |
|-----|--|---------|-----------|----------------------|----------------|
| BI | CETES | 251224 | AAA(mex) | 89,630,130 | 2.27% |
| BI | CETES | 260806 | AAA(mex) | 84,673,130 | 2.14% |
| | Chequera Dolares | | | 1,782,614 | 0.05% |
| CHD | 40-133 | 8032674 | | 1,782,614 | 0.05% |
| | Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial | | | 223,568,978 | 5.65% |
| 93 | AMX | 13024 | F1+ (mex) | 36,540,044 | 0.92% |
| 93 | ELEKTRA | 00124 | HR1 | 30,238,794 | 0.76% |
| 93 | AMX | 08824 | F1+ (mex) | 29,454,662 | 0.74% |
| 93 | AMX | 13324 | F1+ (mex) | 17,214,060 | 0.44% |
| 93 | PCARFM | 04224 | F1+ (mex) | 15,188,510 | 0.38% |
| 93 | MINSA | 00124 | HR2 | 15,107,331 | 0.38% |
| 93 | FINBE | 01524 | HR1 | 15,101,548 | 0.38% |
| 93 | ALMER | 00124 | F1 (mex) | 15,037,644 | 0.38% |
| 93 | LAB | 01123 | F1+ (mex) | 10,326,961 | 0.26% |
| 93 | ALMER | 00324 | F1 (mex) | 10,025,140 | 0.25% |
| 93 | AMX | 13924 | F1+ (mex) | 9,152,254 | 0.23% |
| 93 | AMX | 07124 | F1+ (mex) | 7,690,087 | 0.19% |
| 93 | TOYOTA | 10224 | F1+ (mex) | 6,890,322 | 0.17% |
| 93 | LAB | 00824 | F1+ (mex) | 5,601,620 | 0.14% |
| | Udibonos | | | 70,421,797 | 1.78% |
| S | UDIBONO | 261203 | AAA(mex) | 70,421,797 | 1.78% |
| | Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal | | | 120,566,948 | 3.05% |
| 95 | FNCOT | 23S | AAA (mex) | 120,566,948 | 3.05% |
| | Reportos | | | 734,083,127 | 18.55% |
| IQ | BPAG91 | 270909 | AAA(mex) | 215,537,700 | 5.45% |
| IS | BPA182 | 280412 | AAA(mex) | 195,664,504 | 4.94% |
| BI | CETES | 241128 | AAA(mex) | 173,626,546 | 4.39% |
| BI | CETES | 241128 | AAA(mex) | 122,822,592 | 3.10% |
| BI | CETES | 250116 | AAA(mex) | 26,431,785 | 0.67% |
| | TOTAL CARTERA | | | 3,957,618,717 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 3,950,193,285 | |

Cartera al: 14/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.019 %
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."