

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			100,129,320	1.51%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	100,129,320	1.51%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,052,472,770	15.85%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	219,111,375	3.30%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	187,952,874	2.83%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	156,926,662	2.36%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	141,789,675	2.14%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	97,418,150	1.47%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	91,800,700	1.38%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	84,544,033	1.27%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	49,473,225	0.75%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,456,075	0.35%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			386,678,078	5.82%
93	START	03924	HR+1	64,990,786	0.98%
93	START	04124	HR+1	37,569,258	0.57%
93	START	03624	HR+1	35,849,688	0.54%
93	START	04424	HR+1	31,447,048	0.47%
93	START	03424	HR+1	29,888,735	0.45%
93	START	02124	HR+1	27,149,554	0.41%
93	START	04524	HR+1	22,792,392	0.34%
93	START	03724	HR+1	21,652,562	0.33%
93	START	04324	HR+1	20,150,463	0.30%
93	START	03024	HR+1	18,138,330	0.27%
93	START	02624	HR+1	18,100,141	0.27%
93	START	02824	HR+1	17,659,573	0.27%
93	START	02224	HR+1	13,042,664	0.20%
93	START	03324	HR+1	12,016,815	0.18%
93	START	02324	HR+1	10,012,910	0.15%
93	START	03824	HR+1	6,217,159	0.09%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			773,573,897	11.65%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	208,166,089	3.13%

I	BANREG	25344	F1+ (mex)	203,255,746	3.06%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	201,988,024	3.04%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	160,164,038	2.41%
	Reportos			2,473,503,389	37.24%
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	1,767,548,411	26.61%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	695,707,382	10.47%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	10,247,597	0.15%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,855,966,736	27.94%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	551,787,870	8.31%
LF	BONDESF	251016	AAA(mex)	301,313,670	4.54%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	300,799,242	4.53%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	300,389,883	4.52%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	200,980,514	3.03%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	100,442,022	1.51%
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	100,253,535	1.51%
	TOTAL CARTERA			6,642,324,190	100.00%
	ACTIVO NETO			6,637,966,645	

Cartera al: 29/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.010 %
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."