

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			16,570,171,572	21.17%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	10,518,814,729	13.44%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	3,674,043,505	4.69%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	1,331,393,164	1.70%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	499,281,385	0.64%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	473,923,105	0.61%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	54,108,602	0.07%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	18,607,082	0.02%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			45,779,650,443	58.48%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,128,236,447	11.66%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,091,854,878	6.51%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,493,241,681	5.74%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,121,586,323	5.27%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,075,422,698	5.21%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,825,069,580	4.89%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,981,887,500	3.81%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,798,239,393	3.58%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,264,450,165	2.89%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,983,780,800	2.53%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,826,722,224	2.33%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,222,939,250	1.56%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,126,966,553	1.44%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	431,399,859	0.55%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	315,579,831	0.40%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	92,273,260	0.12%
	Chequera Dolares			190,300,350	0.24%
CHD	40-133	8019671		98,434,802	0.13%
CHD	40-110	1961580		91,865,548	0.12%
	Reportos			15,739,167,356	20.11%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	1,992,695,541	2.55%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	1,846,685,457	2.36%

LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	1,807,048,990	2.31%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	1,363,750,650	1.74%
BI	CETES	240829	AAA(mex)	1,217,750,376	1.56%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	1,024,121,565	1.31%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	1,015,545,639	1.30%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	976,489,478	1.25%
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	848,695,043	1.08%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	506,070,635	0.65%
LD	BONDES	251211	AAA(mex)	502,562,148	0.64%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	485,769,664	0.62%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	461,189,872	0.59%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	418,822,066	0.54%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	258,664,789	0.33%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	228,865,352	0.29%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	210,219,490	0.27%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	197,867,290	0.25%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	193,561,529	0.25%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	73,831,643	0.09%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	66,029,389	0.08%
LD	BONDES	251016	AAA(mex)	42,930,751	0.06%
TOTAL CARTERA				78,279,289,721	100.00%
ACTIVO NETO				78,573,283,704	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.011 %
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."