

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			131,007,791	3.22%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	101,660,527	2.50%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	19,971,255	0.49%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,376,008	0.23%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,852,179	2.43%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,680,172	1.86%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,172,007	0.57%
	Certificados Bursátiles Bancarios			593,118,956	14.59%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	282,102,926	6.94%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,250,191	3.70%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,353,584	2.47%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,113,023	0.86%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,299,232	0.62%
	Certificados Bursátiles Corporativos			624,543,576	15.36%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	202,025,678	4.97%
91	LALA	19-2	AA (mex)	189,609,060	4.66%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	69,175,652	1.70%
91	LAB	23	AA (mex)	30,237,445	0.74%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,115,466	0.74%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,093,325	0.74%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	29,569,028	0.73%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,659,574	0.58%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,058,348	0.49%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,814,987	0.41%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,814,987	0.41%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,132,994,565	27.87%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	273,246,180	6.72%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	217,066,815	5.34%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	180,603,100	4.44%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	96,879,410	2.38%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,072,250	2.31%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,671,780	2.30%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	92,520,700	2.28%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	84,934,330	2.09%
	Chequera Dolares			1,598,824	0.04%
CHD	40-133	8032674		1,598,824	0.04%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			241,332,860	5.94%
93	TPLAY	00223	HR2	40,222,998	0.99%
93	TPLAY	00124	HR2	35,017,604	0.86%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,176,087	0.74%
93	DONDE	00124	HR1	20,053,499	0.49%
93	MINSA	00124	HR2	15,077,812	0.37%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,004,848	0.37%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,940,739	0.34%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,164,265	0.28%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,308,321	0.25%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,003,237	0.25%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,003,182	0.25%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,684,880	0.21%
93	AUTLAN	00323	HR2	7,376,171	0.18%
93	AMX	07124	F1+ (mex)	7,346,655	0.18%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	6,952,564	0.17%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			141,191,245	3.47%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	141,191,245	3.47%
	Udibonos			117,624,194	2.89%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	117,624,194	2.89%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			158,622,215	3.90%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,268,790	2.96%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	38,353,425	0.94%
	Reportos			807,772,074	19.87%
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	700,894,806	17.24%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	53,046,781	1.31%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,793,734	0.56%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	15,557,214	0.38%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	15,479,538	0.38%
	TOTAL CARTERA			4,065,473,466	100.00%
	ACTIVO NETO			4,055,097,777	

Cartera al:

20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.015 %

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."