

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			552,628,340	31.48%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	508,302,635	28.95%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	34,949,697	1.99%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,376,008	0.53%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,084,680,355	61.78%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	270,904,650	15.43%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	217,066,815	12.36%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	182,164,120	10.38%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	96,879,410	5.52%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,072,250	5.36%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,671,780	5.34%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,260,350	2.64%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,467,165	2.42%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,193,815	2.35%
	Udibonos			54,531,058	3.11%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	52,726,038	3.00%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,805,020	0.10%
	Reportos			63,805,888	3.63%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	63,805,888	3.63%
	TOTAL CARTERA			1,755,645,641	100.00%
	ACTIVO NETO			1,754,955,863	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % **Var Promedio:** 0.028 %

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."