

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			249,798,682	19.34%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	205,069,954	15.88%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	35,248,396	2.73%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,480,332	0.73%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			777,265,710	60.17%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	273,109,560	21.14%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	183,588,540	14.21%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,851,490	7.34%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	94,451,520	7.31%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,652,770	3.61%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,938,565	3.32%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,673,265	3.23%
	Udibonos			104,290,063	8.07%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	104,290,063	8.07%
	Reportos			160,383,978	12.42%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	91,295,036	7.07%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	69,088,942	5.35%
	TOTAL CARTERA			1,291,738,433	100.00%
	ACTIVO NETO			1,693,161,813	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.025 %
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."