

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,252,971,025	22.72%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	390,542,302	7.08%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	205,969,075	3.74%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	148,919,168	2.70%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	99,396,250	1.80%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	98,117,910	1.78%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	97,288,090	1.76%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	92,520,700	1.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	48,439,705	0.88%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	47,036,125	0.85%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,741,700	0.45%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				261,431,480	4.74%
93	START	01424	HR+1	55,016,896	1.00%
93	START	01324	HR+1	33,945,739	0.62%
93	START	01824	HR+1	32,025,174	0.58%
93	START	00224	HR+1	27,187,570	0.49%
93	START	01924	HR+1	22,294,264	0.40%
93	START	01724	HR+1	20,006,199	0.36%
93	START	00724	HR+1	18,126,432	0.33%
93	START	00924	HR+1	18,008,294	0.33%
93	START	00324	HR+1	12,965,488	0.24%
93	START	01124	HR+1	11,829,701	0.21%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,025,723	0.18%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				568,635,132	10.31%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	208,558,639	3.78%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	208,164,620	3.77%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	151,911,873	2.75%
Reportos				1,777,258,493	32.23%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	794,196,232	14.40%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	508,875,505	9.23%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	210,674,650	3.82%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	159,985,135	2.90%
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	100,269,103	1.82%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	3,257,868	0.06%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				1,654,940,249	30.01%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	552,395,755	10.02%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	300,626,775	5.45%
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	300,057,444	5.44%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	201,213,422	3.65%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,432,753	1.82%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	100,212,006	1.82%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,002,094	1.81%
TOTAL CARTERA				5,515,236,379	100.00%
ACTIVO NETO				5,460,515,589	

Cartera al: 20/06/2024

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."