

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			14,611,040,210	18.90%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	8,943,562,970	11.57%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,598,155,223	5.95%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	521,884,585	0.68%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	473,910,380	0.61%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	54,139,024	0.07%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	19,388,027	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			48,031,401,471	62.14%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,078,191,396	11.74%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,063,792,742	6.55%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,468,940,105	5.78%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,099,235,810	5.30%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,052,638,570	5.24%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,300,305,820	4.27%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,965,399,500	3.84%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,783,144,492	3.60%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,412,871,760	3.12%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,253,324,701	2.92%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,972,692,400	2.55%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,817,243,756	2.35%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,216,471,880	1.57%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,120,569,950	1.45%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	499,969,620	0.65%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	429,079,796	0.56%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	313,853,774	0.41%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	183,675,400	0.24%
	Chequera Dolares			5,490,875	0.01%
CHD	40-133	8019671		5,490,875	0.01%
	Reportos			14,653,535,609	18.96%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	3,888,035,903	5.03%
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	2,505,259,200	3.24%

LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	1,581,345,439	2.05%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,301,200,273	1.68%
LD	BONDES	251016	AAA(mex)	1,226,666,470	1.59%
LF	BONDES	270617	AAA(mex)	1,095,700,786	1.42%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	845,335,220	1.09%
LF	BONDES	280127	AAA(mex)	796,564,627	1.03%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	692,715,466	0.90%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	665,218,719	0.86%
LD	BONDES	240627	AAA(mex)	55,493,505	0.07%
TOTAL CARTERA				77,301,468,165	100.00%
ACTIVO NETO				77,253,317,556	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % 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."