

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			17,517,410,230	21.74%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	10,552,592,096	13.10%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	3,069,562,392	3.81%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,003,783,560	2.49%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	1,340,433,907	1.66%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	477,781,545	0.59%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	54,506,421	0.07%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	18,750,309	0.02%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			47,816,454,988	59.34%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,156,866,296	11.36%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,107,178,889	6.34%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,506,821,892	5.59%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,134,742,403	5.13%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,087,715,187	5.07%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,837,328,580	4.76%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,990,823,900	3.71%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,806,891,533	3.48%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,271,388,282	2.82%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,989,671,400	2.47%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,895,163,200	2.35%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,832,855,676	2.27%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,226,838,860	1.52%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,130,394,998	1.40%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	432,746,786	0.54%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	316,564,616	0.39%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	92,462,490	0.12%
	Chequera Dolares			98,221,336	0.12%
CHD	40-110	1961580		91,668,321	0.11%
CHD	40-133	8019671		6,553,015	0.01%
	Reportos			15,152,053,553	18.80%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	2,599,501,962	3.23%

LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	2,585,231,784	3.21%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	2,004,088,965	2.49%
LF	BONDESF	270520	AAA(mex)	1,901,757,484	2.36%
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	1,690,197,935	2.10%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,648,801,242	2.05%
LD	BONDES	241024	AAA(mex)	623,724,797	0.77%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	461,308,935	0.57%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	445,515,522	0.55%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	376,899,289	0.47%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	375,505,128	0.47%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	228,994,875	0.28%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	210,525,635	0.26%
TOTAL CARTERA				80,584,140,107	100.00%
ACTIVO NETO				80,629,492,615	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.011 %
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."