

## CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>554,440,753</b>	<b>31.52%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	509,934,865	28.99%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	35,066,212	1.99%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,439,675	0.54%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>1,088,328,148</b>	<b>61.88%</b>
BI	CETES	250529	AAA(mex)	271,903,170	15.46%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	217,721,543	12.38%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	182,644,180	10.39%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	97,170,970	5.53%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,372,220	5.37%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,973,850	5.34%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,415,675	2.64%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,692,480	2.43%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,434,060	2.36%
	<b>Udibonos</b>			<b>53,478,435</b>	<b>3.04%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,478,435	3.04%
	<b>Reportos</b>			<b>62,546,830</b>	<b>3.56%</b>
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	62,546,830	3.56%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,758,794,166</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,760,933,488</b>	

Cartera al: 28/06/2024

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."**