

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				1,247,165,983	23.35%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	388,447,940	7.27%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	205,790,100	3.85%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	148,123,953	2.77%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	98,846,650	1.85%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	97,588,620	1.83%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	96,761,910	1.81%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	92,040,630	1.72%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	48,172,745	0.90%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	46,787,380	0.88%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,606,055	0.46%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				261,558,661	4.90%
93	START	01424	HR+1	55,188,228	1.03%
93	START	01324	HR+1	33,754,533	0.63%
93	START	01024	HR+1	33,257,445	0.62%
93	START	00224	HR+1	27,035,771	0.51%
93	START	04423	HR1	21,231,477	0.40%
93	START	01724	HR+1	20,069,054	0.38%
93	START	00924	HR+1	18,065,743	0.34%
93	START	00724	HR+1	18,025,225	0.34%
93	START	00324	HR+1	13,006,766	0.24%
93	START	01124	HR+1	11,866,780	0.22%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,057,639	0.19%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				565,514,498	10.59%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	207,400,172	3.88%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	207,020,733	3.88%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	151,093,593	2.83%
Reportos				1,858,313,163	34.80%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	1,594,638,245	29.86%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	163,344,145	3.06%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	100,330,773	1.88%

Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				1,407,886,729	26.36%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	554,074,336	10.38%
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	300,963,936	5.64%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	251,291,135	4.71%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,737,706	1.89%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	100,515,264	1.88%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,304,352	1.88%
TOTAL CARTERA				5,340,439,034	100.00%
ACTIVO NETO				5,336,996,157	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.009 %
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."