

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				1,257,368,971	23.11%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	391,767,259	7.20%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	207,170,300	3.81%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	149,311,617	2.74%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	99,694,130	1.83%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	98,421,290	1.81%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	97,582,130	1.79%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	92,831,350	1.71%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	48,585,485	0.89%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	47,186,110	0.87%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,819,300	0.46%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				261,563,880	4.81%
93	START	01424	HR+1	55,188,279	1.01%
93	START	01324	HR+1	33,761,946	0.62%
93	START	01824	HR+1	32,124,930	0.59%
93	START	02124	HR+1	27,035,227	0.50%
93	START	01924	HR+1	22,364,324	0.41%
93	START	01724	HR+1	20,069,073	0.37%
93	START	00924	HR+1	18,064,392	0.33%
93	START	00724	HR+1	18,023,871	0.33%
93	START	00324	HR+1	13,005,875	0.24%
93	START	01124	HR+1	11,869,011	0.22%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,056,953	0.19%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				570,220,728	10.48%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	209,165,725	3.84%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	208,800,676	3.84%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	152,254,328	2.80%
Reportos				1,694,155,690	31.13%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	749,719,727	13.78%
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	680,761,618	12.51%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	163,343,330	3.00%

LD	BONDES	241024	AAA(mex)	100,331,016	1.84%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,658,351,449	30.48%
LF	BONDES	250116	AAA(mex)	554,100,306	10.18%
LF	BONDES	260604	AAA(mex)	301,570,647	5.54%
LF	BONDES	240815	AAA(mex)	300,983,022	5.53%
LF	BONDES	250403	AAA(mex)	200,123,354	3.68%
LF	BONDES	241024	AAA(mex)	100,742,717	1.85%
LF	BONDES	241128	AAA(mex)	100,520,834	1.85%
LF	BONDES	241107	AAA(mex)	100,310,569	1.84%
	TOTAL CARTERA			5,441,660,718	100.00%
	ACTIVO NETO			5,438,377,149	

Cartera al: 28/06/2024

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."