

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Trimestral De Ir			50,490,292	1.79%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,490,292	1.79%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			645,652,482	22.89%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	173,345,520	6.15%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	165,736,240	5.88%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	141,558,330	5.02%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	47,776,495	1.69%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,415,675	1.65%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	46,231,245	1.64%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,588,977	0.87%
	Chequera Dolares			116,702	0.00%
CHD	40-133	8031130		116,702	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			160,710,057	5.70%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,938,325	0.71%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	19,255,852	0.68%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,130,573	0.68%
93	START	00724	HR+1	18,023,871	0.64%
93	START	02124	HR+1	17,022,180	0.60%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,534,801	0.55%
93	START	00324	HR+1	12,289,368	0.44%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,056,953	0.36%
93	START	01724	HR+1	10,034,537	0.36%
93	GMFIN	05324	F1+ (mex)	9,796,587	0.35%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,627,010	0.34%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			185,554,456	6.58%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	81,276,292	2.88%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	52,423,644	1.86%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	51,854,521	1.84%
	Reportos			869,195,541	30.82%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	410,084,074	14.54%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	257,054,252	9.11%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	202,057,216	7.16%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				908,981,432	32.23%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	499,759,880	17.72%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,123,751	3.55%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,874,462	3.54%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,656,156	3.53%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,612,567	3.53%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	9,954,616	0.35%
TOTAL CARTERA				2,820,700,962	100.00%
ACTIVO NETO				2,815,279,721	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.018 %
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."