

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			17,498,913,028	21.82%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	10,542,633,730	13.15%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	3,066,761,668	3.82%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,001,799,960	2.50%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	1,338,452,638	1.67%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	476,175,635	0.59%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	54,383,426	0.07%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	18,705,972	0.02%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			47,774,349,611	59.57%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,148,599,243	11.41%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,102,712,977	6.36%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,502,941,897	5.62%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,130,973,366	5.15%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,084,198,823	5.09%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,834,220,780	4.78%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,988,147,300	3.73%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,804,408,085	3.50%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,269,310,647	2.83%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,987,902,200	2.48%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,893,472,400	2.36%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,831,264,908	2.28%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,225,768,570	1.53%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,129,392,552	1.41%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	432,367,741	0.54%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	316,284,722	0.39%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	92,383,400	0.12%
	Chequera Dolares			190,885,317	0.24%
CHD	40-110	1961580		184,289,189	0.23%
CHD	40-133	8019671		6,596,128	0.01%
	Reportos			14,728,758,965	18.37%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	3,142,352,704	3.92%

LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	2,135,791,563	2.66%
LF	BONDESF	270520	AAA(mex)	1,900,581,525	2.37%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	1,848,006,575	2.30%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	1,348,336,743	1.68%
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	968,752,455	1.21%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	570,246,257	0.71%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	548,880,672	0.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	461,809,069	0.58%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	461,144,480	0.58%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	445,129,749	0.56%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	305,991,335	0.38%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	228,792,286	0.29%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	210,338,481	0.26%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	152,605,071	0.19%
TOTAL CARTERA				80,192,906,921	100.00%
ACTIVO NETO				80,248,929,081	

Cartera al: 27/06/2024

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."