

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			131,334,451	3.32%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	101,890,729	2.58%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,018,000	0.51%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,425,723	0.24%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,410,740	2.49%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,188,087	1.90%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,222,653	0.59%
	Certificados Bursátiles Bancarios			594,244,700	15.02%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	282,750,499	7.15%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,602,274	3.81%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,579,368	2.54%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,192,314	0.89%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,120,245	0.64%
	Certificados Bursátiles Corporativos			621,265,305	15.70%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,600,596	5.07%
91	LALA	19-2	AA (mex)	188,317,980	4.76%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	68,689,843	1.74%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,182,480	0.76%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,175,229	0.76%
91	LAB	23	AA (mex)	30,029,827	0.76%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	29,372,961	0.74%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,793,406	0.60%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,102,984	0.51%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,704,734	0.42%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,704,734	0.42%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,135,651,763	28.70%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	273,771,120	6.92%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	217,534,253	5.50%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	181,046,820	4.58%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	97,086,000	2.45%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,289,890	2.38%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,889,860	2.37%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	92,750,780	2.34%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	85,283,040	2.16%
	Chequera Dolares			1,602,180	0.04%
CHD	40-133	8032674		1,602,180	0.04%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			261,374,845	6.61%
93	TPLAY	00223	HR2	40,320,768	1.02%
93	TPLAY	00124	HR2	35,107,750	0.89%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,248,862	0.77%
93	AMX	08824	F1+ (mex)	28,178,537	0.71%
93	DONDE	00124	HR1	20,100,531	0.51%
93	MINSA	00124	HR2	15,112,141	0.38%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,039,271	0.38%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,971,509	0.35%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,189,038	0.28%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,331,104	0.26%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,026,225	0.25%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,025,784	0.25%
93	AUTLAN	00323	HR2	7,392,823	0.19%
93	AMX	07124	F1+ (mex)	7,362,651	0.19%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	6,967,852	0.18%
	Udibonos			119,107,791	3.01%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	119,107,791	3.01%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			158,981,001	4.02%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,538,106	3.05%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	38,442,895	0.97%
	Reportos			817,840,323	20.67%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	779,567,030	19.70%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,793,734	0.58%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	15,479,559	0.39%
	TOTAL CARTERA			3,956,517,833	100.00%
	ACTIVO NETO			3,953,485,383	
	Cartera al:	27/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.015 %

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."