

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 | | | | 1,256,088,190 | 22.89% |
| BI | CETES | 241128 | AAA(mex) | 391,419,497 | 7.13% |
| BI | CETES | 260416 | AAA(mex) | 206,790,575 | 3.77% |
| BI | CETES | 250430 | AAA(mex) | 149,205,260 | 2.72% |
| BI | CETES | 240711 | AAA(mex) | 99,604,910 | 1.82% |
| BI | CETES | 240822 | AAA(mex) | 98,334,210 | 1.79% |
| BI | CETES | 240919 | AAA(mex) | 97,498,120 | 1.78% |
| BI | CETES | 250306 | AAA(mex) | 92,750,780 | 1.69% |
| BI | CETES | 241003 | AAA(mex) | 48,543,000 | 0.88% |
| BI | CETES | 250109 | AAA(mex) | 47,144,945 | 0.86% |
| BI | CETES | 240725 | AAA(mex) | 24,796,893 | 0.45% |
| Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial | | | | 261,319,996 | 4.76% |
| 93 | START | 01424 | HR+1 | 55,136,951 | 1.01% |
| 93 | START | 01324 | HR+1 | 33,730,575 | 0.62% |
| 93 | START | 01824 | HR+1 | 32,094,996 | 0.59% |
| 93 | START | 02124 | HR+1 | 27,009,909 | 0.49% |
| 93 | START | 01924 | HR+1 | 22,343,301 | 0.41% |
| 93 | START | 01724 | HR+1 | 20,050,242 | 0.37% |
| 93 | START | 00924 | HR+1 | 18,047,591 | 0.33% |
| 93 | START | 00724 | HR+1 | 18,007,124 | 0.33% |
| 93 | START | 00324 | HR+1 | 12,993,756 | 0.24% |
| 93 | START | 01124 | HR+1 | 11,857,962 | 0.22% |
| 93 | START | 00424 | F1+ (mex) | 10,047,591 | 0.18% |
| Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs) | | | | 569,712,352 | 10.38% |
| I | BANREG | 24454 | F1+ (mex) | 208,988,169 | 3.81% |
| I | BANREG | 24324 | F1+ (mex) | 208,609,078 | 3.80% |
| I | BANREG | 25181 | F1+ (mex) | 152,115,106 | 2.77% |
| Reportos | | | | 1,744,486,124 | 31.79% |
| IQ | BPAG91 | 251231 | AAA(mex) | 1,480,973,820 | 26.98% |
| BI | CETES | 241003 | AAA(mex) | 163,243,056 | 2.97% |
| BI | CETES | 240808 | AAA(mex) | 100,269,249 | 1.83% |

| Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal | | | | 1,656,815,834 | 30.19% |
|---|---------|--------|----------|----------------------|----------------|
| LF | BONDESF | 250116 | AAA(mex) | 553,587,639 | 10.09% |
| LF | BONDESF | 260604 | AAA(mex) | 301,290,018 | 5.49% |
| LF | BONDESF | 240815 | AAA(mex) | 300,704,754 | 5.48% |
| LF | BONDESF | 250403 | AAA(mex) | 199,938,204 | 3.64% |
| LF | BONDESF | 241024 | AAA(mex) | 100,649,490 | 1.83% |
| LF | BONDESF | 241128 | AAA(mex) | 100,427,901 | 1.83% |
| LF | BONDESF | 241107 | AAA(mex) | 100,217,828 | 1.83% |
| TOTAL CARTERA | | | | 5,488,422,496 | 100.00% |
| ACTIVO NETO | | | | 5,485,826,808 | |

Cartera al: 27/06/2024

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."