

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			50,444,007	1.79%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,444,007	1.79%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			644,897,887	22.87%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	173,162,640	6.14%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	165,432,460	5.87%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	141,434,835	5.02%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	47,734,085	1.69%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,375,390	1.64%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	46,191,700	1.64%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,566,777	0.87%
	Chequera Dolares			117,483	0.00%
CHD	40-133	8031130		117,483	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			160,559,843	5.69%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,919,917	0.71%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	19,237,978	0.68%
93	GMFIN	05424	F1+ (mex)	19,112,091	0.68%
93	START	00724	HR+1	18,007,124	0.64%
93	START	02124	HR+1	17,006,239	0.60%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,520,464	0.55%
93	START	00324	HR+1	12,277,917	0.44%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,047,591	0.36%
93	START	01724	HR+1	10,025,121	0.36%
93	GMFIN	05324	F1+ (mex)	9,787,476	0.35%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,617,927	0.34%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			185,388,528	6.57%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	81,202,486	2.88%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	52,375,539	1.86%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	51,810,503	1.84%
	Reportos			870,907,498	30.88%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	318,631,229	11.30%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	295,380,390	10.47%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	256,895,879	9.11%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			908,115,921	32.20%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	499,294,090	17.70%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,030,310	3.55%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,781,177	3.54%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,563,066	3.53%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,506,105	3.53%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	9,941,173	0.35%
	TOTAL CARTERA			2,820,431,167	100.00%
	ACTIVO NETO			2,813,541,413	

Cartera al: 27/06/2024

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."