

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			130,420,875	3.32%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	100,366,613	2.56%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,731,692	0.53%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,322,570	0.24%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,628,812	2.51%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,354,488	1.92%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,274,323	0.59%
	Certificados Bursátiles Bancarios			593,076,518	15.10%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	280,841,355	7.15%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,947,208	3.84%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,831,139	2.57%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,271,697	0.90%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,185,119	0.64%
	Certificados Bursátiles Corporativos			592,684,525	15.09%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,979,392	5.12%
91	LALA	19-2	AA (mex)	188,629,540	4.80%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	68,942,750	1.76%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,257,042	0.77%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,223,272	0.77%
91	LAB	23	AA (mex)	30,098,877	0.77%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,406,817	0.60%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,146,837	0.51%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,741,283	0.43%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,741,283	0.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,105,382,793	28.14%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	214,340,153	5.46%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	199,633,340	5.08%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	135,033,090	3.44%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	99,392,050	2.53%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,659,060	2.44%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,933,980	2.37%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	92,533,170	2.36%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	91,421,610	2.33%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	84,436,340	2.15%
	Chequera Dolares			26,647,302	0.68%
CHD	40-133	8032674		26,647,302	0.68%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,767,476	2.57%
D2	GS227	240515	BBB+	100,767,476	2.57%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			299,588,260	7.63%
93	TPLAY	00223	HR2	40,028,116	1.02%
93	GCARSO	00224	F1+ (mex)	35,278,199	0.90%
93	TPLAY	00124	HR2	35,206,178	0.90%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,030,967	0.77%
93	DONDE	00124	HR1	20,147,618	0.51%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,073,834	0.38%
93	MINSA	00124	HR2	15,004,893	0.38%
93	AMX	01924	F1+ (mex)	14,940,188	0.38%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,879,367	0.35%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,017,546	0.28%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,354,583	0.26%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,049,306	0.26%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,048,476	0.26%
93	PCARFM	01724	F1+ (mex)	9,936,702	0.25%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,646,772	0.22%
93	AUTLAN	00323	HR2	7,342,963	0.19%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	6,861,480	0.18%
93	SICREAC	00124	HR2	5,741,073	0.15%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			140,551,552	3.58%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	140,551,552	3.58%
	Udibonos			119,858,796	3.05%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	119,858,796	3.05%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			120,807,666	3.08%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,807,666	3.08%
	Reportos			582,742,041	14.84%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	457,624,332	11.65%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	86,844,463	2.21%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,793,735	0.58%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	15,479,510	0.39%

TOTAL CARTERA	3,927,897,899	100.00%
ACTIVO NETO	3,923,548,676	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.014 %
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."
