

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			45,603,030	3.26%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	36,280,460	2.59%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,322,570	0.67%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,013,444,933	72.47%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	214,340,153	15.33%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	199,633,340	14.27%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	99,392,050	7.11%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,659,060	6.84%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,933,980	6.65%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	92,533,170	6.62%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	90,022,060	6.44%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,710,805	3.27%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,218,170	3.02%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,002,145	2.93%
	Udibonos			55,646,973	3.98%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,727,717	3.84%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,919,256	0.14%
	Reportos			283,841,747	20.30%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	283,841,747	20.30%
	TOTAL CARTERA			1,398,536,683	100.00%
	ACTIVO NETO			1,398,312,994	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.022 %
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."