

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				1,106,008,525	20.81%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	282,261,660	5.31%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	123,006,435	2.32%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	109,497,240	2.06%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	98,122,530	1.85%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	96,882,080	1.82%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	96,072,250	1.81%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	91,421,610	1.72%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	90,022,060	1.69%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	47,829,530	0.90%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	46,466,990	0.87%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,426,140	0.46%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				287,849,433	5.42%
93	START	01424	HR+1	55,257,489	1.04%
93	START	01324	HR+1	33,797,049	0.64%
93	START	01024	HR+1	33,010,260	0.62%
93	START	00224	HR+1	27,071,595	0.51%
93	START	04223	HR+1	24,539,532	0.46%
93	START	00824	HR+1	22,102,996	0.42%
93	START	04423	HR1	21,073,674	0.40%
93	START	00924	HR+1	18,085,016	0.34%
93	START	00724	HR+1	18,049,097	0.34%
93	START	00324	HR+1	12,910,094	0.24%
93	START	01124	HR+1	11,881,697	0.22%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,070,934	0.19%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				561,819,698	10.57%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	205,924,890	3.88%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	205,516,041	3.87%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	150,378,767	2.83%
Reportos				1,755,709,272	33.04%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	979,386,486	18.43%

IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	512,810,507	9.65%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	110,292,589	2.08%
LD	BONDES	250619	AAA(mex)	100,269,226	1.89%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	52,950,465	1.00%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				1,602,719,070	30.16%
LF	BONDES	250116	AAA(mex)	549,988,602	10.35%
LF	BONDES	240815	AAA(mex)	301,320,465	5.67%
LF	BONDES	260604	AAA(mex)	249,442,755	4.69%
LF	BONDES	240523	AAA(mex)	200,914,306	3.78%
LF	BONDES	241128	AAA(mex)	100,633,764	1.89%
LF	BONDES	241107	AAA(mex)	100,423,097	1.89%
LF	BONDES	241024	AAA(mex)	99,996,081	1.88%
TOTAL CARTERA				5,314,105,998	100.00%
ACTIVO NETO				5,312,237,661	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.006 %
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."