

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			51,099,142	1.86%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	51,099,142	1.86%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			516,962,560	18.85%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	171,346,080	6.25%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	139,400,970	5.08%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	49,696,025	1.81%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,710,805	1.67%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	45,607,070	1.66%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,002,145	1.50%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,199,465	0.88%
	Chequera Dolares			107,163	0.00%
CHD	40-133	8031130		107,163	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			165,651,090	6.04%
93	START	00224	HR+1	27,071,595	0.99%
93	START	04223	HR+1	24,539,532	0.90%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,614,742	0.72%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	18,940,792	0.69%
93	START	00724	HR+1	18,049,097	0.66%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,279,448	0.56%
93	START	00324	HR+1	12,198,864	0.45%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,070,934	0.37%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,469,355	0.35%
93	GMFIN	13023	F1+ (mex)	7,296,924	0.27%
93	GMFIN	12723	F1+ (mex)	3,119,807	0.11%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			182,917,665	6.67%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	80,267,614	2.93%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	51,598,969	1.88%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	51,051,082	1.86%
	Reportos			926,438,919	33.77%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	418,004,784	15.24%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	256,895,808	9.37%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	205,126,946	7.48%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	46,411,382	1.69%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				900,014,357	32.81%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	500,227,855	18.24%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,253,209	3.66%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,026,402	3.65%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,762,999	3.64%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,743,892	3.64%
TOTAL CARTERA				2,743,190,897	100.00%
ACTIVO NETO				2,746,633,402	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.013 %
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."