

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/1CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>131,335,187</b>	<b>3.47%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	101,091,477	2.67%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,875,383	0.55%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,368,326	0.25%
	<b>Certificados Bursatiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>98,503,502</b>	<b>2.60%</b>
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,258,757	1.99%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,244,746	0.61%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>592,255,780</b>	<b>15.63%</b>
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	280,444,405	7.40%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,748,616	3.98%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,688,384	2.66%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,225,991	0.93%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,148,384	0.66%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>621,740,516</b>	<b>16.40%</b>
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,777,926	5.30%
91	LALA	19-2	AA (mex)	188,528,898	4.97%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	68,846,231	1.82%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,211,316	0.80%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,210,077	0.80%
91	LAB	23	AA (mex)	30,059,086	0.79%
91	GCARSO	24	AAA (mex)	29,400,583	0.78%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,584,877	0.62%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,121,521	0.53%
	<b>Certificado Bursatiles de Corto Plazo Gubernamental</b>			<b>16,720,310</b>	<b>0.44%</b>
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,720,310	0.44%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>1,127,365,508</b>	<b>29.74%</b>
BI	CETES	250430	AAA(mex)	271,787,070	7.17%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	215,853,278	5.70%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	179,776,640	4.74%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	96,345,490	2.54%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	93,574,760	2.47%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,186,900	2.46%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	92,040,630	2.43%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	84,800,740	2.24%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>18,444,850</b>	<b>0.49%</b>
CHD	40-133	8032674		18,444,850	0.49%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>282,803,694</b>	<b>7.46%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	40,362,450	1.07%
93	GCARSO	00224	F1+ (mex)	35,233,265	0.93%
93	TPLAY	00124	HR2	35,145,249	0.93%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,279,846	0.80%
93	DONDE	00124	HR1	20,120,662	0.53%
93	MINSA	00124	HR2	15,122,746	0.40%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,053,979	0.40%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,984,592	0.37%
93	FINBE	00624	F1+ (mex)	11,100,293	0.29%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,341,151	0.27%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,036,047	0.27%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,035,439	0.27%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,635,875	0.23%
93	AUTLAN	00323	HR2	7,399,904	0.20%
93	AMX	07124	F1+ (mex)	7,305,246	0.19%
93	AMX	06224	F1+ (mex)	6,913,370	0.18%
93	SICREAC	00124	HR2	5,733,581	0.15%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>140,402,942</b>	<b>3.70%</b>
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	140,402,942	3.70%
	<b>Udibonos</b>			<b>119,936,304</b>	<b>3.16%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	119,936,304	3.16%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>158,773,701</b>	<b>4.19%</b>
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,652,391	3.18%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	38,121,310	1.01%
	<b>Reportos</b>			<b>481,986,911</b>	<b>12.72%</b>
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	443,689,979	11.71%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	22,807,856	0.60%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	15,489,075	0.41%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,790,269,205</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,785,679,747</b>	

**Cartera al:**

**31/05/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.017 %**

**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."**