

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				1,120,946,590	21.74%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	281,432,730	5.46%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	109,236,673	2.12%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	100,000,000	1.94%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	97,880,190	1.90%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	96,645,300	1.88%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	95,828,000	1.86%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	91,156,040	1.77%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	89,665,610	1.74%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	47,704,635	0.93%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	46,329,495	0.90%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	40,700,945	0.79%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,366,973	0.47%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				291,448,882	5.65%
93	START	01424	HR+1	55,120,238	1.07%
93	START	01324	HR+1	34,009,703	0.66%
93	START	01024	HR+1	33,216,391	0.64%
93	START	00224	HR+1	27,242,496	0.53%
93	START	04223	HR+1	24,478,580	0.48%
93	START	00824	HR+1	22,048,095	0.43%
93	START	04423	HR1	21,206,888	0.41%
93	START	00724	HR+1	18,158,900	0.35%
93	START	00924	HR+1	18,039,698	0.35%
93	START	00324	HR+1	12,991,694	0.25%
93	START	01124	HR+1	11,851,924	0.23%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,045,919	0.20%
93	START	00624	HR+1	3,038,355	0.06%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				513,960,649	9.97%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	205,317,369	3.98%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	204,984,128	3.98%
I	BANREG	24194	F1+ (mex)	103,659,152	2.01%

	Reportos			1,622,606,856	31.47%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	1,359,013,922	26.36%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	163,292,915	3.17%
LD	BONDES	250814	AAA(mex)	100,300,020	1.95%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,606,398,134	31.16%
LF	BONDES	250116	AAA(mex)	553,320,014	10.73%
LF	BONDES	240815	AAA(mex)	300,571,353	5.83%
LF	BONDES	260604	AAA(mex)	250,934,840	4.87%
LF	BONDES	240523	AAA(mex)	200,417,648	3.89%
LF	BONDES	241024	AAA(mex)	100,604,797	1.95%
LF	BONDES	241128	AAA(mex)	100,378,927	1.95%
LF	BONDES	241107	AAA(mex)	100,170,555	1.94%
	TOTAL CARTERA			5,155,361,111	100.00%
	ACTIVO NETO			5,062,308,959	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.005 %
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."