

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			45,230,791	3.90%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	35,975,664	3.11%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,255,127	0.80%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			875,173,405	75.52%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	212,556,690	18.34%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	197,921,940	17.08%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	98,539,000	8.50%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	94,860,310	8.19%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,177,230	7.96%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	91,842,260	7.93%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,390,020	3.92%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	41,885,955	3.62%
	Udibonos			54,906,290	4.74%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,010,032	4.58%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,896,258	0.16%
	Reportos			183,486,760	15.83%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	183,486,760	15.83%
	TOTAL CARTERA			1,158,797,246	100.00%
	ACTIVO NETO			1,158,611,386	

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.023 %
 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."