

## CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>984,952,440</b>	<b>19.67%</b>
BI	CETES	241128	AAA(mex)	279,883,380	5.59%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	108,557,460	2.17%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	99,390,490	1.99%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	97,294,670	1.94%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	96,055,360	1.92%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	95,254,280	1.90%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	90,780,040	1.81%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	47,430,155	0.95%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	46,088,615	0.92%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,217,990	0.48%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>290,720,164</b>	<b>5.81%</b>
93	START	00524	HR+1	55,188,311	1.10%
93	START	01324	HR+1	33,796,859	0.68%
93	START	01024	HR+1	33,010,264	0.66%
93	START	00224	HR+1	27,073,494	0.54%
93	START	04223	HR+1	24,510,479	0.49%
93	START	00824	HR+1	22,075,379	0.44%
93	START	04423	HR1	21,075,288	0.42%
93	START	00924	HR+1	18,062,223	0.36%
93	START	00724	HR+1	18,045,256	0.36%
93	START	00324	HR+1	12,908,149	0.26%
93	START	01124	HR+1	11,883,875	0.24%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,071,081	0.20%
93	START	00624	HR+1	3,019,506	0.06%
<b>Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)</b>				<b>510,921,422</b>	<b>10.20%</b>
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	204,128,004	4.08%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	203,765,038	4.07%
I	BANREG	24194	F1+ (mex)	103,028,380	2.06%
<b>Reportos</b>				<b>1,517,568,622</b>	<b>30.30%</b>
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,254,056,251	25.04%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	151,562,169	3.03%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	100,269,276	2.00%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	11,680,926	0.23%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>1,703,857,831</b>	<b>34.02%</b>
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	549,891,030	10.98%
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	301,378,512	6.02%
LF	BONDESF	240425	AAA(mex)	200,977,470	4.01%
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	200,963,530	4.01%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	149,601,002	2.99%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	100,621,989	2.01%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,441,189	2.01%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	99,983,109	2.00%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>5,008,020,479</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>5,005,737,270</b>	

**Cartera al: 11/04/2024**

**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."**