

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			50,663,184	1.87%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,663,184	1.87%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			621,263,537	22.87%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	169,986,600	6.26%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	149,085,735	5.49%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	138,265,845	5.09%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	49,269,500	1.81%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,390,020	1.67%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	45,272,590	1.67%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	23,993,247	0.88%
	Chequera Dolares			104,888	0.00%
CHD	40-133	8031130		104,888	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			162,581,972	5.98%
93	START	00224	HR+1	27,073,494	1.00%
93	START	04223	HR+1	24,510,479	0.90%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,439,067	0.72%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	18,776,564	0.69%
93	START	00724	HR+1	18,045,256	0.66%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,144,443	0.56%
93	START	00324	HR+1	12,197,026	0.45%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,071,081	0.37%
93	GMFIN	13023	F1+ (mex)	7,233,520	0.27%
93	GMFIN	12123	F1+ (mex)	4,992,496	0.18%
93	GMFIN	12723	F1+ (mex)	3,092,791	0.11%
93	GMFIN	12423	F1+ (mex)	2,005,756	0.07%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			151,867,520	5.59%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	51,159,345	1.88%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	50,605,614	1.86%
I	BANREG	24191	F1+ (mex)	50,102,562	1.84%

	Reportos			830,261,272	30.56%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	463,200,122	17.05%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	256,895,942	9.46%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	88,313,621	3.25%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	21,851,587	0.80%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			900,022,121	33.13%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	500,288,105	18.42%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,233,487	3.69%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,029,073	3.68%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,743,463	3.67%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,727,993	3.67%
	TOTAL CARTERA			2,716,764,494	100.00%
	ACTIVO NETO			2,713,700,786	

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.010 %
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."