

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>520,930</b>	<b>0.05%</b>
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	520,930	0.05%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>45,193,168</b>	<b>3.92%</b>
M	BONOS	241205	AAA(mex)	35,899,520	3.12%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,293,648	0.81%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>778,360,243</b>	<b>67.55%</b>
BI	CETES	241017	AAA(mex)	211,931,663	18.39%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	197,279,540	17.12%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	98,218,710	8.52%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	91,973,030	7.98%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	91,646,840	7.95%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,298,125	3.93%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,012,335	3.65%
	<b>Udibonos</b>			<b>55,235,739</b>	<b>4.79%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,312,967	4.63%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,922,772	0.17%
	<b>Reportos</b>			<b>272,927,643</b>	<b>23.69%</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	272,927,643	23.69%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,152,237,723</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,151,837,942</b>	

**Cartera al:** 27/03/2024

**Límite Máximo de VaR:** 0.100 % **Var Promedio:** 0.025 %  
**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."**