

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			50,491,809	1.86%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,491,809	1.86%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			620,447,144	22.86%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	170,400,620	6.28%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	148,590,735	5.48%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	137,959,545	5.08%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	49,109,355	1.81%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,298,125	1.67%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	45,171,785	1.67%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	23,916,979	0.88%
	Chequera Dolares			105,701	0.00%
CHD	40-133	8031130		105,701	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			174,880,042	6.44%
93	START	03823	HR+1	29,918,894	1.10%
93	START	00224	HR+1	27,217,751	1.00%
93	START	04223	HR+1	24,678,729	0.91%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,373,521	0.71%
93	START	00724	HR+1	18,145,167	0.67%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,094,262	0.56%
93	START	00324	HR+1	12,264,373	0.45%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,036,375	0.37%
93	GMFIN	13023	F1+ (mex)	7,208,416	0.27%
93	GMFIN	12123	F1+ (mex)	4,975,496	0.18%
93	GMFIN	12723	F1+ (mex)	3,082,121	0.11%
93	GMFIN	12423	F1+ (mex)	1,998,879	0.07%
93	GMFIN	11023	F1+ (mex)	886,060	0.03%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			101,436,393	3.74%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	50,985,436	1.88%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	50,450,957	1.86%

	Reportos			868,529,629	32.01%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	372,388,307	13.72%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	280,369,663	10.33%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	141,276,962	5.21%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	67,020,584	2.47%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	7,474,113	0.28%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			897,786,864	33.08%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	498,578,840	18.37%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	100,249,775	3.69%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,891,026	3.68%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,687,240	3.67%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,379,983	3.66%
	TOTAL CARTERA			2,713,677,582	100.00%
	ACTIVO NETO			2,719,883,419	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.012 %
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."