

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/1CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			129,573,604	3.14%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	99,729,487	2.41%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,600,927	0.50%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,243,190	0.22%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,568,768	2.39%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,449,456	1.83%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,119,312	0.56%
	Certificados Bursátiles Bancarios			592,519,236	14.34%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	281,517,107	6.81%
94	BACTIN	22	AA (mex)	149,891,510	3.63%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,938,359	2.44%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,033,927	0.85%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,138,334	0.61%
	Certificados Bursátiles Corporativos			653,307,432	15.81%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	201,519,202	4.88%
91	LALA	19-2	AA (mex)	189,138,675	4.58%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	69,107,879	1.67%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,163,934	1.46%
91	LAB	23	AA (mex)	30,168,105	0.73%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,021,623	0.73%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,011,436	0.73%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,163,585	0.56%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,012,992	0.48%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,777,879	0.41%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,777,879	0.41%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			963,952,260	23.32%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	212,965,380	5.15%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	198,357,660	4.80%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	98,758,280	2.39%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,048,940	2.30%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,339,910	2.23%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	91,961,260	2.23%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	90,846,480	2.20%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	83,674,350	2.03%
	Chequera Dolares			1,480,462	0.04%
CHD	40-133	8032674		1,480,462	0.04%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,075,162	2.42%
D2	GS227	240515	BBB+	100,075,162	2.42%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			315,508,132	7.63%
93	TPLAY	00223	HR2	40,125,580	0.97%
93	TPLAY	00123	HR2	38,310,341	0.93%
93	GCARSO	00224	F1+ (mex)	35,044,440	0.85%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,103,481	0.73%
93	ALMER	00223	F1 (mex)	25,195,677	0.61%
93	DONDE	00124	HR1	20,006,590	0.48%
93	AMX	01324	F1+ (mex)	18,129,247	0.44%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,088,566	0.37%
93	MINSA	00124	HR2	15,039,236	0.36%
93	AMX	01924	F1+ (mex)	14,844,128	0.36%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,910,035	0.34%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,286,264	0.25%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,058,145	0.24%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,646,797	0.21%
93	LAB	00823	F1+ (mex)	7,659,133	0.19%
93	AUTLAN	00323	HR2	7,359,557	0.18%
93	SICREAC	00124	HR2	5,700,915	0.14%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			140,657,829	3.40%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	140,657,829	3.40%
	Udibonos			118,585,190	2.87%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	118,585,190	2.87%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			121,099,301	2.93%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	121,099,301	2.93%
	Reportos			880,966,985	21.32%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	748,201,274	18.10%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	94,492,479	2.29%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,793,734	0.55%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	15,479,498	0.38%
	TOTAL CARTERA			4,133,072,240	100.00%

ACTIVO NETO

4,022,694,390

Cartera al:

18/04/2024

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."