

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			45,294,812	3.49%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	36,051,622	2.78%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,243,190	0.71%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			876,691,845	67.53%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	212,965,380	16.40%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	198,357,660	15.28%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	98,758,280	7.61%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,048,940	7.32%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,339,910	7.11%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	91,961,260	7.08%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,423,240	3.50%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	41,837,175	3.22%
	Udibonos			54,989,799	4.24%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,156,813	4.10%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,832,986	0.14%
	Reportos			321,256,741	24.75%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	321,256,741	24.75%
	TOTAL CARTERA			1,298,233,197	100.00%
	ACTIVO NETO			1,297,802,251	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.022 %
 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."