

## CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>				<b>986,863,179</b>	<b>19.86%</b>
BI	CETES	241128	AAA(mex)	280,439,670	5.64%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	108,799,034	2.19%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	99,603,680	2.00%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	97,504,420	1.96%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	96,253,690	1.94%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	95,452,350	1.92%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	90,846,480	1.83%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	47,524,470	0.96%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	46,169,955	0.93%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,269,430	0.49%
<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>				<b>291,159,950</b>	<b>5.86%</b>
93	START	00524	HR+1	55,308,752	1.11%
93	START	01324	HR+1	33,871,247	0.68%
93	START	01024	HR+1	33,082,307	0.67%
93	START	00224	HR+1	27,132,561	0.55%
93	START	04223	HR+1	24,563,937	0.49%
93	START	00824	HR+1	22,123,526	0.45%
93	START	04423	HR1	21,121,283	0.43%
93	START	00924	HR+1	18,101,966	0.36%
93	START	00724	HR+1	18,084,974	0.36%
93	START	00324	HR+1	12,936,570	0.26%
93	START	01124	HR+1	11,803,644	0.24%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,003,088	0.20%
93	START	00624	HR+1	3,026,094	0.06%
<b>Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)</b>				<b>511,947,319</b>	<b>10.30%</b>
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	204,547,741	4.12%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	204,150,136	4.11%
I	BANREG	24194	F1+ (mex)	103,249,441	2.08%
<b>Reportos</b>				<b>1,373,236,572</b>	<b>27.63%</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,109,724,327	22.33%

BI	CETES	241003	AAA(mex)	163,243,056	3.29%
BI	CETES	240606	AAA(mex)	96,489,163	1.94%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	3,780,026	0.08%
<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>				<b>1,806,653,355</b>	<b>36.35%</b>
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	551,088,850	11.09%
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	302,029,629	6.08%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	249,890,798	5.03%
LF	BONDESF	240425	AAA(mex)	201,411,480	4.05%
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	201,397,510	4.05%
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	100,658,089	2.03%
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,199,036	2.02%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	99,977,964	2.01%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>4,969,860,375</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>4,966,098,456</b>	

**Cartera al: 18/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.005 %**  
**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."**