

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			50,771,467	1.84%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,771,467	1.84%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			621,990,415	22.56%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	169,876,700	6.16%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	149,405,520	5.42%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	138,509,865	5.02%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	49,379,140	1.79%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,423,240	1.65%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	45,351,740	1.65%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,044,210	0.87%
	Chequera Dolares			108,851	0.00%
CHD	40-133	8031130		108,851	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			162,849,707	5.91%
93	START	00224	HR+1	27,132,561	0.98%
93	START	04223	HR+1	24,563,937	0.89%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,482,553	0.71%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	18,817,469	0.68%
93	START	00724	HR+1	18,084,974	0.66%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,178,469	0.55%
93	START	00324	HR+1	12,223,881	0.44%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,003,088	0.36%
93	GMFIN	13023	F1+ (mex)	7,249,636	0.26%
93	GMFIN	12123	F1+ (mex)	5,003,378	0.18%
93	GMFIN	12723	F1+ (mex)	3,099,618	0.11%
93	GMFIN	12423	F1+ (mex)	2,010,142	0.07%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			152,175,617	5.52%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	51,256,031	1.86%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	50,709,671	1.84%
I	BANREG	24191	F1+ (mex)	50,209,915	1.82%

	Reportos			868,234,635	31.49%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	406,632,907	14.75%
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	256,895,742	9.32%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	184,132,824	6.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	20,573,161	0.75%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			901,130,293	32.68%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	501,376,075	18.18%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,246,660	3.64%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,968,083	3.63%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,950,815	3.63%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,588,660	3.61%
	TOTAL CARTERA			2,757,260,985	100.00%
	ACTIVO NETO			2,741,688,919	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.010 %
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."