

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados De La Tesorería De La Federación				982,202,904	20.29%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	279,246,030	5.77%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	108,204,606	2.24%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	99,060,490	2.05%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	96,972,490	2.00%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	95,752,290	1.98%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	94,959,790	1.96%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	90,596,250	1.87%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	47,283,435	0.98%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	45,986,515	0.95%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,141,008	0.50%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				288,211,130	5.95%
93	START	00524	HR+1	55,562,222	1.15%
93	START	01024	HR+1	33,190,979	0.69%
93	START	03823	HR+1	29,918,894	0.62%
93	START	00224	HR+1	27,217,751	0.56%
93	START	04223	HR+1	24,678,729	0.51%
93	START	00824	HR+1	22,224,794	0.46%
93	START	04423	HR1	21,192,269	0.44%
93	START	00924	HR+1	18,185,524	0.38%
93	START	00724	HR+1	18,145,167	0.38%
93	START	00324	HR+1	12,979,422	0.27%
93	START	01124	HR+1	11,842,922	0.25%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,036,375	0.21%
93	START	00624	HR+1	3,036,082	0.06%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				509,258,258	10.52%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	203,504,164	4.20%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	203,072,369	4.19%
I	BANREG	24194	F1+ (mex)	102,681,726	2.12%
Reportos				1,457,400,820	30.10%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,315,068,441	27.16%

LD	BONDES	250220	AAA(mex)	142,332,379	2.94%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,604,476,246	33.14%
LF	BONDES	250116	AAA(mex)	452,293,740	9.34%
LF	BONDES	240815	AAA(mex)	300,348,138	6.20%
LF	BONDES	240425	AAA(mex)	200,293,950	4.14%
LF	BONDES	240523	AAA(mex)	200,278,284	4.14%
LF	BONDES	260604	AAA(mex)	150,372,803	3.11%
LF	BONDES	241024	AAA(mex)	100,508,402	2.08%
LF	BONDES	241128	AAA(mex)	100,280,565	2.07%
LF	BONDES	241107	AAA(mex)	100,100,364	2.07%
	TOTAL CARTERA			4,841,549,358	100.00%
	ACTIVO NETO			4,837,854,221	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.006 %
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."