

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			50,974,020	1.87%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,974,020	1.87%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			664,793,992	24.37%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	170,321,680	6.25%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	150,000,000	5.50%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	138,988,485	5.10%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	49,577,765	1.82%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,578,020	1.67%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	45,486,250	1.67%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	40,700,945	1.49%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,140,847	0.89%
	Chequera Dolares			109,303	0.00%
CHD	40-133	8031130		109,303	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			163,329,300	5.99%
93	START	00224	HR+1	27,242,496	1.00%
93	START	04223	HR+1	24,478,580	0.90%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,563,248	0.72%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	18,891,991	0.69%
93	START	00724	HR+1	18,158,900	0.67%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,239,493	0.56%
93	START	00324	HR+1	12,275,969	0.45%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,045,919	0.37%
93	GMFIN	13023	F1+ (mex)	7,278,849	0.27%
93	GMFIN	12123	F1+ (mex)	5,023,500	0.18%
93	GMFIN	12723	F1+ (mex)	3,112,119	0.11%
93	GMFIN	12423	F1+ (mex)	2,018,236	0.07%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			152,775,271	5.60%
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	51,465,422	1.89%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	50,900,471	1.87%
I	BANREG	24191	F1+ (mex)	50,409,378	1.85%

	Reportos			797,008,335	29.22%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	438,166,201	16.06%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	256,974,772	9.42%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	101,867,362	3.74%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			898,556,056	32.94%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	498,945,650	18.29%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	100,355,250	3.68%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,996,262	3.67%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,772,235	3.66%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,486,659	3.65%
	TOTAL CARTERA			2,727,546,277	100.00%
	ACTIVO NETO			2,720,274,434	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.011 %
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."