

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/1CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			130,132,242	3.26%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	100,155,857	2.51%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	20,688,011	0.52%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,288,374	0.23%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			98,413,606	2.46%
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	75,191,126	1.88%
CD	BANOB	23	AAA (mex)	23,222,481	0.58%
	Certificados Bursátiles Bancarios			594,222,970	14.87%
94	BACTIN	21-2	AA (mex)	282,811,173	7.08%
94	BACTIN	22	AA (mex)	150,594,723	3.77%
94	BACTIN	23	AA (mex)	100,605,176	2.52%
94	BLADEX	24	AAA (mex)	35,192,314	0.88%
94	BMIFEL	23V	AA (mex)	25,019,583	0.63%
	Certificados Bursátiles Corporativos			651,716,413	16.31%
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	200,506,494	5.02%
91	LALA	19-2	AA (mex)	188,208,996	4.71%
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	68,782,286	1.72%
91	ALSEA	19	A+ (mex)	60,447,493	1.51%
91	BRX	22-2	AAA (mex)	30,174,999	0.76%
91	GCARSO	23	AAA (mex)	30,155,948	0.75%
91	LAB	23	AA (mex)	30,029,747	0.75%
91	AXO	16-2	A+ (mex)	23,308,298	0.58%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	20,102,153	0.50%
	Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental			16,704,507	0.42%
92	FONDO	01623	F1+ (mex)	16,704,507	0.42%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,102,552,315	27.58%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	213,859,080	5.35%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	199,208,440	4.98%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	134,621,745	3.37%

BI	CETES	240530	AAA(mex)	99,185,390	2.48%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,444,840	2.39%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,709,730	2.32%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	92,315,290	2.31%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	91,196,410	2.28%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	84,011,390	2.10%
	Chequera Dolares			26,961,891	0.68%
CHD	40-133	8032674		26,961,891	0.68%
	Eurobonos de Empresas Privadas			100,536,330	2.52%
D2	GS227	240515	BBB+	100,536,330	2.52%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			300,268,184	7.51%
93	TPLAY	00223	HR2	40,320,890	1.01%
93	GCARSO	00224	F1+ (mex)	35,200,155	0.88%
93	TPLAY	00124	HR2	35,116,120	0.88%
93	ELEKTRA	00124	HR1	30,248,862	0.76%
93	DONDE	00124	HR1	20,100,531	0.50%
93	AMX	01324	F1+ (mex)	18,207,569	0.46%
93	MINSA	00124	HR2	15,108,087	0.38%
93	ALMER	00124	F1 (mex)	15,039,387	0.38%
93	AMX	01924	F1+ (mex)	14,908,138	0.37%
93	LAB	00524	F1+ (mex)	13,971,510	0.35%
93	LAB	01123	F1+ (mex)	10,331,776	0.26%
93	ALMER	00324	F1 (mex)	10,026,302	0.25%
93	AUTLAN	00423	HR2	10,025,861	0.25%
93	PCARFM	01724	F1+ (mex)	9,914,732	0.25%
93	LAB	00424	F1+ (mex)	8,627,777	0.22%
93	AUTLAN	00323	HR2	7,392,823	0.19%
93	SICREAC	00124	HR2	5,727,665	0.14%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			140,246,807	3.51%
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	140,246,807	3.51%
	Udibonos			119,022,436	2.98%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	119,022,436	2.98%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			120,538,097	3.02%
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	120,538,097	3.02%
	Reportos			595,731,762	14.90%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	387,092,637	9.68%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	170,365,850	4.26%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	22,793,731	0.57%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	15,479,544	0.39%

TOTAL CARTERA	3,997,047,560	100.00%
ACTIVO NETO	3,965,867,207	

Cartera al: **02/05/2024**

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.014 %
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."
