

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			8,446,995,130	11.25%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,554,694,564	6.07%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,851,437,249	3.80%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	517,200,285	0.69%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	469,957,190	0.63%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	53,705,842	0.07%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			49,968,315,644	66.57%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	8,992,321,217	11.98%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,016,455,758	6.68%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,427,241,135	5.90%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,411,931,075	5.88%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,015,197,574	5.35%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,269,131,977	4.36%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,146,534,500	4.19%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,937,177,000	3.91%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,757,054,033	3.67%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,390,300,120	3.19%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,231,965,528	2.97%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,953,964,600	2.60%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,800,575,535	2.40%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,205,226,490	1.61%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	495,248,302	0.66%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	425,072,441	0.57%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	310,906,239	0.41%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	182,012,120	0.24%
	Chequera Dolares			294,310,512	0.39%
CHD	40-110	1961580		290,227,040	0.39%
CHD	40-133	8019671		4,083,472	0.01%
	Reportos			16,349,908,447	21.78%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	3,258,851,270	4.34%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	2,993,565,495	3.99%

LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	2,362,211,003	3.15%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	2,127,316,850	2.83%
LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	1,900,583,699	2.53%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	1,270,166,441	1.69%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	968,916,209	1.29%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	418,433,315	0.56%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	345,153,669	0.46%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	338,720,259	0.45%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	174,359,583	0.23%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	83,580,419	0.11%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	66,008,580	0.09%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	42,041,656	0.06%
TOTAL CARTERA				75,059,529,733	100.00%
ACTIVO NETO				75,007,451,559	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % 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."