

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			7,878,317,443	10.66%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,067,724,431	5.51%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,825,399,526	3.82%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	512,850,290	0.69%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	472,343,195	0.64%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			55,626,557,149	75.29%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	7,940,975,839	10.75%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	7,726,718,220	10.46%
BI	CETES	240418	AAA(mex)	7,565,481,378	10.24%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,385,709,355	5.94%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,369,211,129	5.91%
BI	CETES	240425	AAA(mex)	3,504,237,001	4.74%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,237,384,765	4.38%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,115,867,766	4.22%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,730,773,921	3.70%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,373,953,140	3.21%
BI	CETES	240404	AAA(mex)	2,297,870,430	3.11%
BI	CETES	240411	AAA(mex)	1,993,857,000	2.70%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,788,726,018	2.42%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,195,649,390	1.62%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	490,447,576	0.66%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	421,073,036	0.57%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	307,934,046	0.42%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	180,687,140	0.25%
	Chequera Dolares			451,006,925	0.61%
CHD	40-110	1961580		448,554,133	0.61%
CHD	40-133	8019671		2,452,793	0.00%
	Reportos			9,923,849,003	13.43%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,839,202,253	2.49%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	1,378,735,225	1.87%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	1,106,327,290	1.50%

IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,011,336,758	1.37%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	901,382,441	1.22%
IS	BPA182	260903	AAA(mex)	702,300,755	0.95%
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	701,077,202	0.95%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	655,378,892	0.89%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	612,484,644	0.83%
LD	BONDES	250220	AAA(mex)	271,239,450	0.37%
LF	BONDES	270819	AAA(mex)	225,831,337	0.31%
LF	BONDES	270422	AAA(mex)	200,311,032	0.27%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	174,423,030	0.24%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	143,818,693	0.20%
TOTAL CARTERA				73,879,730,520	100.00%
ACTIVO NETO				72,397,010,186	

Cartera al: 27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % 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."