

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			13,995,947,953	16.50%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	4,814,602,885	5.68%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	4,691,531,340	5.53%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	2,507,128,728	2.96%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	1,982,685,000	2.34%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			52,383,356,931	61.74%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	6,685,995,359	7.88%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	6,067,161,976	7.15%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	5,489,463,200	6.47%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	5,299,730,604	6.25%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	5,245,172,861	6.18%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	5,083,219,395	5.99%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	3,854,214,780	4.54%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	3,220,883,464	3.80%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	2,611,107,454	3.08%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	2,307,838,250	2.72%
BI	CETES	250416	AAA(mex)	2,209,936,087	2.61%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,972,392,000	2.33%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,276,909,270	1.51%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	1,059,332,230	1.25%
	Chequera Dolares			300,347,931	0.35%
CHD	40-133	8019671		300,347,931	0.35%
	Udibonos			4,221,049,443	4.98%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	4,221,049,443	4.98%
	Reportos			13,939,205,347	16.43%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	5,073,780,213	5.98%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	1,928,776,179	2.27%
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	1,497,233,299	1.77%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	1,091,847,102	1.29%
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	1,050,306,541	1.24%

LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	1,007,775,869	1.19%
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	950,276,995	1.12%
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	543,301,289	0.64%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	385,160,624	0.45%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	152,559,320	0.18%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	100,029,106	0.12%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	97,345,161	0.12%
LF	BONDESF	340323	AAA(mex)	60,813,649	0.07%
TOTAL CARTERA				84,839,907,605	100.00%
ACTIVO NETO				84,204,830,781	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.029 %
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."