

## CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>8,368,379,455</b>	<b>11.50%</b>
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,507,675,473	6.19%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,833,792,169	3.89%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	513,938,050	0.71%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	468,372,800	0.64%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	44,600,963	0.06%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>59,400,360,395</b>	<b>81.63%</b>
BI	CETES	240725	AAA(mex)	7,966,298,567	10.95%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	7,752,458,220	10.65%
BI	CETES	240418	AAA(mex)	7,591,045,586	10.43%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	4,985,733,627	6.85%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,399,310,349	6.05%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,383,438,561	6.02%
BI	CETES	240425	AAA(mex)	3,515,995,431	4.83%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,248,242,378	4.46%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,126,028,572	4.30%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,918,840,100	4.01%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,739,417,220	3.76%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,378,411,360	3.27%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,792,354,755	2.46%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,198,303,990	1.65%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	492,089,901	0.68%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	422,386,271	0.58%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	308,915,148	0.43%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	181,090,360	0.25%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>448,146,255</b>	<b>0.62%</b>
CHD	40-110	1961580		444,196,372	0.61%
CHD	40-133	8019671		3,949,883	0.01%
	<b>Reportos</b>			<b>4,555,148,446</b>	<b>6.26%</b>
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	997,216,291	1.37%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	921,369,557	1.27%

IS	BPA182	300328	AAA(mex)	900,275,238	1.24%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	611,896,538	0.84%
LF	BONDESF	261022	AAA(mex)	466,829,860	0.64%
LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	400,122,634	0.55%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	206,000,828	0.28%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	27,110,676	0.04%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	24,326,824	0.03%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>72,772,034,551</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>72,772,426,752</b>	

**Cartera al: 11/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.012 %**  
**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."**