

## CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>104,256,252</b>	<b>1.40%</b>
M	BONOS	241205	AAA(mex)	104,256,252	1.40%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>6,429,455,426</b>	<b>86.43%</b>
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,676,533,200	22.54%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,058,906,817	14.24%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	948,350,610	12.75%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	840,021,170	11.29%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	694,740,410	9.34%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	675,137,830	9.08%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	240,095,513	3.23%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	198,523,295	2.67%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,146,580	1.31%
	<b>Reportos</b>			<b>905,248,078</b>	<b>12.17%</b>
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	793,135,533	10.66%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	112,112,545	1.51%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>7,438,959,756</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>7,437,782,780</b>	

**Cartera al:** 07/11/2024

**Límite Máximo de VaR:** 0.050 % **Var Promedio:** 0.007 %

**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."**