

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			11,481,489,316	13.59%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	4,789,355,347	5.67%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	4,681,411,290	5.54%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	2,010,722,679	2.38%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			44,493,430,881	52.67%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	6,054,233,436	7.17%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	5,457,909,600	6.46%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	5,288,864,250	6.26%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	5,233,059,614	6.19%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,986,986,780	4.72%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	3,846,406,590	4.55%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	3,214,242,147	3.81%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	2,605,510,004	3.08%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	2,301,965,000	2.73%
BI	CETES	250416	AAA(mex)	2,204,691,210	2.61%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,968,370,400	2.33%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,274,283,140	1.51%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	1,056,908,710	1.25%
	Chequera Dolares			2,359,857	0.00%
CHD	40-133	8019671		2,359,857	0.00%
	Udibonos			3,401,755,765	4.03%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	3,401,755,765	4.03%
	Reportos			25,100,362,278	29.71%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	5,047,516,460	5.98%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	3,217,984,091	3.81%
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	2,466,538,092	2.92%
IS	BPA182	260903	AAA(mex)	2,356,060,049	2.79%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	2,323,858,727	2.75%
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	1,526,563,800	1.81%
IS	BPA182	310918	AAA(mex)	1,352,344,658	1.60%

IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	1,030,900,854	1.22%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	786,155,278	0.93%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	766,831,281	0.91%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	688,139,783	0.82%
BI	CETES	250116	AAA(mex)	655,567,294	0.78%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	605,345,941	0.72%
IQ	BPAG91	290111	AAA(mex)	534,346,886	0.63%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	491,003,977	0.58%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	426,409,130	0.51%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	402,182,261	0.48%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	200,098,898	0.24%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	114,109,691	0.14%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	100,356,609	0.12%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	8,048,521	0.01%
TOTAL CARTERA				84,479,398,097	100.00%
ACTIVO NETO				82,927,398,062	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.025 %
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."