

## 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>8,391,549,716</b>	<b>11.35%</b>
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,525,047,019	6.12%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,839,298,495	3.84%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	515,023,170	0.70%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	467,701,030	0.63%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	44,480,003	0.06%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>58,588,087,143</b>	<b>79.26%</b>
BI	CETES	240725	AAA(mex)	7,983,219,311	10.80%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	7,769,087,040	10.51%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	4,995,647,772	6.76%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,408,458,194	5.96%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,393,088,587	5.94%
BI	CETES	240425	AAA(mex)	3,523,535,158	4.77%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,255,010,592	4.40%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,132,984,960	4.24%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,925,132,600	3.96%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,745,073,423	3.71%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	2,504,472,869	3.39%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,381,205,580	3.22%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,223,770,714	3.01%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,945,998,600	2.63%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,793,666,542	2.43%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,200,418,830	1.62%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	493,116,818	0.67%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	423,236,827	0.57%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	309,555,766	0.42%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	181,406,960	0.25%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>294,827,011</b>	<b>0.40%</b>
CHD	40-110	1961580		290,726,485	0.39%
CHD	40-133	8019671		4,100,526	0.01%
	<b>Reportos</b>			<b>6,640,544,695</b>	<b>8.98%</b>

LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	1,972,008,757	2.67%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	1,492,325,591	2.02%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	700,213,808	0.95%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	567,410,182	0.77%
LF	BONDESF	321021	AAA(mex)	366,191,781	0.50%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	350,568,126	0.47%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	337,699,479	0.46%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	319,318,297	0.43%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	304,420,390	0.41%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	230,388,285	0.31%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>73,915,008,565</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>73,853,377,566</b>	

**Cartera al: 18/04/2024**

**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."**