

## 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>14,022,631,977</b>	<b>16.33%</b>
M	BONOS	260305	AAA(mex)	4,822,492,216	5.61%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	4,700,830,185	5.47%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	2,511,847,156	2.92%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	1,987,462,420	2.31%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>47,195,175,400</b>	<b>54.94%</b>
BI	CETES	250206	AAA(mex)	6,702,483,551	7.80%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	6,081,693,876	7.08%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	5,503,753,450	6.41%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	5,257,400,924	6.12%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	5,095,264,058	5.93%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	3,862,487,070	4.50%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	3,228,737,362	3.76%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	2,616,118,219	3.05%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	2,313,694,750	2.69%
BI	CETES	250416	AAA(mex)	2,215,030,240	2.58%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,976,811,000	2.30%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,279,860,010	1.49%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	1,061,840,890	1.24%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>2,474,076</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8019671		2,474,076	0.00%
	<b>Udibonos</b>			<b>4,226,090,627</b>	<b>4.92%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	4,226,090,627	4.92%
	<b>Reportos</b>			<b>20,449,750,663</b>	<b>23.81%</b>
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	2,394,079,017	2.79%
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	2,036,241,943	2.37%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	1,900,347,857	2.21%
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	1,816,586,460	2.12%
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	1,596,402,342	1.86%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	1,533,920,387	1.79%

LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	1,527,958,569	1.78%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	1,253,316,105	1.46%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	1,099,328,990	1.28%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	828,145,817	0.96%
LF	BONDESF	340323	AAA(mex)	697,254,747	0.81%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	512,814,495	0.60%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	495,449,547	0.58%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	491,350,771	0.57%
IQ	BPAG91	290111	AAA(mex)	400,117,031	0.47%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	399,863,129	0.47%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	386,952,102	0.45%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	374,002,083	0.44%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	350,355,792	0.41%
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	203,357,838	0.24%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	150,043,807	0.18%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	1,861,836	0.00%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>85,896,122,743</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>85,839,078,382</b>	

**Cartera al: 14/11/2024**

**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."**