

## 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>8,489,372,747</b>  | <b>11.28%</b> |
| M       | BONOS  | 250306  | AAA(mex)   | 4,568,149,901         | 6.07%         |
| M       | BONOS  | 240905  | AAA(mex)   | 2,857,437,472         | 3.80%         |
| M       | BONOS  | 241205  | AAA(mex)   | 518,292,290           | 0.69%         |
| M       | BONOS  | 260903  | AAA(mex)   | 472,058,835           | 0.63%         |
| M       | BONOS  | 270304  | AAA(mex)   | 54,053,418            | 0.07%         |
| M       | BONOS  | 270603  | AAA(mex)   | 19,380,831            | 0.03%         |
|         | <b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b> |         |            | <b>51,193,077,176</b> | <b>67.99%</b> |
| BI      | CETES  | 240725  | AAA(mex)   | 9,011,813,311         | 11.97%        |
| BI      | CETES  | 241003  | AAA(mex)   | 5,027,714,880         | 6.68%         |
| BI      | CETES  | 240919  | AAA(mex)   | 4,437,088,220         | 5.89%         |
| BI      | CETES  | 240516  | AAA(mex)   | 4,421,341,467         | 5.87%         |
| BI      | CETES  | 241017  | AAA(mex)   | 4,024,229,695         | 5.35%         |
| BI      | CETES  | 240613  | AAA(mex)   | 3,276,151,124         | 4.35%         |
| BI      | CETES  | 240530  | AAA(mex)   | 3,153,090,534         | 4.19%         |
| BI      | CETES  | 240711  | AAA(mex)   | 2,943,675,900         | 3.91%         |
| BI      | CETES  | 240822  | AAA(mex)   | 2,762,994,572         | 3.67%         |
| BI      | CETES  | 250206  | AAA(mex)   | 2,396,146,480         | 3.18%         |
| BI      | CETES  | 250403  | AAA(mex)   | 2,238,334,145         | 2.97%         |
| BI      | CETES  | 240718  | AAA(mex)   | 1,958,268,800         | 2.60%         |
| BI      | CETES  | 250306  | AAA(mex)   | 1,805,021,868         | 2.40%         |
| BI      | CETES  | 250109  | AAA(mex)   | 1,208,141,740         | 1.61%         |
| BI      | CETES  | 241031  | AAA(mex)   | 1,112,763,166         | 1.48%         |
| BI      | CETES  | 240620  | AAA(mex)   | 496,309,495           | 0.66%         |
| BI      | CETES  | 240905  | AAA(mex)   | 426,002,966           | 0.57%         |
| BI      | CETES  | 240808  | AAA(mex)   | 311,560,532           | 0.41%         |
| BI      | CETES  | 250320  | AAA(mex)   | 182,428,280           | 0.24%         |
|         | <b>Chequera Dolares</b>                              |         |            | <b>207,052,812</b>    | <b>0.28%</b>  |
| CHD     | 40-110   | 1961580 |            | 201,621,315           | 0.27%         |
| CHD     | 40-133   | 8019671 |            | 5,431,497             | 0.01%         |
|         | <b>Reportos</b>                                      |         |            | <b>15,405,743,703</b> | <b>20.46%</b> |

|                      |         |        |          |                       |                |
|----------------------|---------|--------|----------|-----------------------|----------------|
| IM                   | BPAG28  | 250508 | AAA(mex) | 2,692,718,418         | 3.58%          |
| LF                   | BONDESF | 261203 | AAA(mex) | 1,816,811,539         | 2.41%          |
| LF                   | BONDESF | 250724 | AAA(mex) | 1,700,146,204         | 2.26%          |
| LF                   | BONDESF | 261231 | AAA(mex) | 1,649,995,319         | 2.19%          |
| LF                   | BONDESF | 280615 | AAA(mex) | 1,101,925,399         | 1.46%          |
| LF                   | BONDESF | 280127 | AAA(mex) | 1,067,892,539         | 1.42%          |
| LF                   | BONDESF | 270617 | AAA(mex) | 1,013,252,279         | 1.35%          |
| LF                   | BONDESF | 281228 | AAA(mex) | 987,358,751           | 1.31%          |
| LF                   | BONDESF | 261203 | AAA(mex) | 832,689,513           | 1.11%          |
| LF                   | BONDESF | 270318 | AAA(mex) | 739,696,791           | 0.98%          |
| IS                   | BPA182  | 260219 | AAA(mex) | 499,140,214           | 0.66%          |
| IQ                   | BPAG91  | 270909 | AAA(mex) | 498,785,500           | 0.66%          |
| BI                   | CETES   | 241003 | AAA(mex) | 227,078,315           | 0.30%          |
| S                    | UDIBONO | 501103 | AAA(mex) | 202,216,035           | 0.27%          |
| S                    | UDIBONO | 340824 | AAA(mex) | 199,273,455           | 0.27%          |
| BI                   | CETES   | 241003 | AAA(mex) | 176,763,432           | 0.24%          |
| <b>TOTAL CARTERA</b> |         |        |          | <b>75,295,246,438</b> | <b>100.00%</b> |
| <b>ACTIVO NETO</b>   |         |        |          | <b>75,244,838,679</b> |                |

**Cartera al: 09/05/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.010 %**  
**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."**