

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			8,434,498,633	11.28%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,545,383,559	6.08%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,850,757,271	3.81%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	516,874,685	0.69%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	468,063,335	0.63%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	53,419,782	0.07%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			57,751,472,807	77.24%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	8,989,983,973	12.02%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	7,800,000,000	10.43%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,014,586,245	6.71%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,425,807,555	5.92%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,410,561,486	5.90%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,013,651,455	5.37%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,268,163,671	4.37%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,145,587,228	4.21%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,936,405,700	3.93%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,756,241,808	3.69%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,389,266,620	3.20%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,230,593,351	2.98%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,953,454,600	2.61%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,799,778,473	2.41%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,204,566,870	1.61%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	495,106,625	0.66%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	424,948,051	0.57%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	310,824,097	0.42%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	181,945,000	0.24%
	Chequera Dolares			296,570,311	0.40%
CHD	40-110	1961580		292,451,809	0.39%
CHD	40-133	8019671		4,118,502	0.01%
	Reportos			8,287,081,550	11.08%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	1,948,177,981	2.61%

LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	1,739,626,622	2.33%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	900,553,498	1.20%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	810,959,642	1.09%
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	546,939,584	0.73%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	488,467,349	0.65%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	421,682,945	0.56%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	345,102,135	0.46%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	338,649,684	0.45%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	329,208,157	0.44%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	216,800,160	0.29%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	200,913,793	0.27%
TOTAL CARTERA				74,769,623,301	100.00%
ACTIVO NETO				74,721,098,311	

Cartera al: 30/04/2024

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."