

## 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>8,365,246,843</b>	<b>10.24%</b>
M	BONOS	260305	AAA(mex)	4,767,227,488	5.84%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	3,598,019,355	4.41%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>43,877,177,404</b>	<b>53.72%</b>
BI	CETES	250306	AAA(mex)	5,986,048,284	7.33%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	5,452,194,150	6.68%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,235,787,901	6.41%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,240,346,532	5.19%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,191,413,283	5.13%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,941,664,970	4.83%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	3,178,289,834	3.89%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	2,573,556,185	3.15%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,335,913,900	2.86%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	2,283,472,750	2.80%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,945,001,600	2.38%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,259,417,640	1.54%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,159,030,626	1.42%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	95,039,750	0.12%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>79,267,040</b>	<b>0.10%</b>
CHD	40-110	1961580		77,288,972	0.10%
CHD	40-133	8019671		1,978,068	0.00%
	<b>Reportos</b>			<b>29,360,254,621</b>	<b>35.95%</b>
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	5,582,352,836	6.83%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	4,519,154,200	5.53%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	3,991,706,788	4.89%
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	3,501,047,989	4.29%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	1,639,137,580	2.01%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	1,547,205,811	1.89%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	1,484,757,294	1.82%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,408,188,298	1.72%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	1,392,084,420	1.70%

IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	1,391,236,914	1.70%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	900,268,971	1.10%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	436,026,929	0.53%
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	298,509,051	0.37%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	297,612,286	0.36%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	285,505,762	0.35%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	202,856,611	0.25%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	196,834,407	0.24%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	159,169,071	0.20%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	117,110,706	0.14%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	9,488,696	0.01%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>81,681,945,908</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>81,800,517,186</b>	

**Cartera al: 19/09/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.021 %**

**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."