

## 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>16,280,218,949</b>	<b>20.50%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	10,609,294,070	13.36%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	2,784,540,295	3.51%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,014,194,040	2.54%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	872,190,544	1.10%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>43,561,831,951</b>	<b>54.85%</b>
BI	CETES	240725	AAA(mex)	9,206,654,933	11.59%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,135,000,306	6.47%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,531,731,261	5.71%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,155,986,379	5.23%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,109,806,942	5.17%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,856,555,120	4.86%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,822,417,073	3.55%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,282,803,677	2.87%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,904,763,400	2.40%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,842,218,050	2.32%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,233,069,370	1.55%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,136,426,798	1.43%
BI	CETES	240801	AAA(mex)	498,021,750	0.63%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	435,154,590	0.55%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	318,299,832	0.40%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	92,922,470	0.12%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>204,795,761</b>	<b>0.26%</b>
CHD	40-110	1961580		198,081,183	0.25%
CHD	40-133	8019671		6,714,578	0.01%
	<b>Udibonos</b>			<b>1,707,499,693</b>	<b>2.15%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	1,707,499,693	2.15%
	<b>Reportos</b>			<b>17,672,837,292</b>	<b>22.25%</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	3,496,545,585	4.40%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	2,950,603,136	3.72%

LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	2,815,746,613	3.55%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	2,072,527,920	2.61%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	2,039,986,985	2.57%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	1,590,470,881	2.00%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	570,508,642	0.72%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	489,745,391	0.62%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	443,434,870	0.56%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	401,046,507	0.51%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	325,623,680	0.41%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	244,279,462	0.31%
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	228,175,477	0.29%
LD	BONDES	260212	AAA(mex)	4,142,142	0.01%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>79,427,183,646</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>79,447,966,582</b>	

**Cartera al: 18/07/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.009 %**  
**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."**