

## 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>18,730,226,969</b>	<b>22.07%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	13,250,740,153	15.61%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	2,924,482,866	3.45%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	2,555,003,950	3.01%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>40,099,823,581</b>	<b>47.24%</b>
BI	CETES	260806	AAA(mex)	5,374,842,200	6.33%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,208,017,466	6.14%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,595,052,620	5.41%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	4,216,533,130	4.97%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,168,647,319	4.91%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	3,915,739,440	4.61%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	3,156,712,273	3.72%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,320,823,411	2.73%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,933,360,800	2.28%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,870,576,060	2.20%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,251,607,630	1.48%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	1,152,704,754	1.36%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	840,804,318	0.99%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	94,402,160	0.11%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>1,906,284</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8019671		1,906,284	0.00%
	<b>Reportos</b>			<b>26,050,993,605</b>	<b>30.69%</b>
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	4,476,994,693	5.27%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	2,195,820,218	2.59%
LF	BONDESF	270520	AAA(mex)	2,101,767,194	2.48%
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	2,080,382,092	2.45%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,840,114,088	2.17%
LG	BONDESG	260716	AAA(mex)	1,438,606,517	1.70%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	1,321,872,627	1.56%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,278,777,013	1.51%
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	1,229,565,930	1.45%

LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	1,124,650,797	1.33%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	1,063,689,253	1.25%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	921,472,731	1.09%
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	862,089,084	1.02%
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	658,702,114	0.78%
IS	BPA182	290927	AAA(mex)	500,458,333	0.59%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	495,800,180	0.58%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	493,349,390	0.58%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	408,528,945	0.48%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	403,938,051	0.48%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	270,647,355	0.32%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	264,245,207	0.31%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	225,476,034	0.27%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	194,308,468	0.23%
LD	BONDES	241219	AAA(mex)	86,915,303	0.10%
LD	BONDES	251211	AAA(mex)	60,909,765	0.07%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	51,912,223	0.06%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>84,882,950,439</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>82,893,088,465</b>	

**Cartera al: 30/08/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.007 %**  
**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."**