

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				7,865,803,927
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,061,194,746
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,821,149,866
M	BONOS	241205	AAA(mex)	512,156,875
M	BONOS	260903	AAA(mex)	471,302,440
Certificados De La Tesorería De La Federación				55,543,212,315
BI	CETES	240725	AAA(mex)	7,929,137,239
BI	CETES	240502	AAA(mex)	7,714,989,360
BI	CETES	240418	AAA(mex)	7,554,219,134
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,379,143,246
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,362,410,133
BI	CETES	240425	AAA(mex)	3,498,994,951
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,232,566,405
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,111,072,083
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,726,810,045
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,370,286,100
BI	CETES	240404	AAA(mex)	2,294,363,620
BI	CETES	240411	AAA(mex)	1,990,873,400
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,786,351,613
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,193,862,670
BI	CETES	240620	AAA(mex)	489,720,145
BI	CETES	240905	AAA(mex)	420,456,645
BI	CETES	240808	AAA(mex)	307,484,326
BI	CETES	250320	AAA(mex)	180,471,200
Chequera Dolares				453,286,591
CHD	40-110	1961580		450,819,763
CHD	40-133	8019671		2,466,827
Reportos				9,397,625,344
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	1,853,036,143
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	1,150,621,162
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	1,105,243,512
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	1,053,698,912
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	946,914,933
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	900,276,489

LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	700,214,776
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	457,479,771
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	404,694,881
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	400,121,039
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	205,232,192
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	136,698,686
BI	CETES	241003	AAA(mex)	52,402,191
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	30,990,657
TOTAL CARTERA				73,259,928,177
ACTIVO NETO				71,795,497,222

Cartera al: 26/03/2024

Límite Máximo de VaR: 0.067 % Var Promedio: 0.010 %
Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y c
observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por lo que pueden afectar al instrumento de forma simultánea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo que implica que el riesgo asociado es alto."

ión

AAA/2CP

%

10.74%

5.54%

3.85%

0.70%

0.64%

75.82%

10.82%

10.53%

10.31%

5.98%

5.96%

4.78%

4.41%

4.25%

3.72%

3.24%

3.13%

2.72%

2.44%

1.63%

0.67%

0.57%

0.42%

0.25%

0.62%

0.62%

0.00%

12.83%

2.53%

1.57%

1.51%

1.44%

1.29%

1.23%

0.96%
0.62%
0.55%
0.55%
0.28%
0.19%
0.07%
0.04%

100.00%

on una muestra de 252

**ios y valores
acto negativo debido
alguno de los
ido a que los factores
encionar algunos
valores, lo anterior**
