

**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			8,417,032,451	11.28%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	4,535,533,760	6.08%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	2,845,164,027	3.81%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	515,820,040	0.69%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	467,157,410	0.63%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	53,357,215	0.07%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			57,646,564,556	77.26%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	8,972,963,786	12.03%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	7,785,715,080	10.44%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	5,005,596,081	6.71%
BI	CETES	240919	AAA(mex)	4,417,512,746	5.92%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	4,402,487,905	5.90%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	4,006,513,963	5.37%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	3,262,174,074	4.37%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	3,139,668,841	4.21%
BI	CETES	240711	AAA(mex)	2,930,895,000	3.93%
BI	CETES	240822	AAA(mex)	2,751,018,525	3.69%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,385,297,980	3.20%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	2,227,415,211	2.99%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	1,949,787,000	2.61%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	1,796,808,393	2.41%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	1,202,453,980	1.61%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	494,202,940	0.66%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	424,155,120	0.57%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	310,226,071	0.42%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	181,671,860	0.24%
	Chequera Dolares			297,832,705	0.40%
CHD	40-110	1961580		293,694,116	0.39%
CHD	40-133	8019671		4,138,589	0.01%
	Reportos			8,249,422,338	11.06%
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	2,422,914,615	3.25%

LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	1,105,767,473	1.48%
LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	900,275,152	1.21%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	890,738,861	1.19%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	874,797,459	1.17%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	535,100,266	0.72%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	338,109,112	0.45%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	328,406,851	0.44%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	319,893,843	0.43%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	291,147,192	0.39%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	242,271,515	0.33%
TOTAL CARTERA				74,610,852,050	100.00%
ACTIVO NETO				74,601,588,902	

Cartera al: 25/04/2024

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."