

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			101,660,527	4.56%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	101,660,527	4.56%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,310,122,420	58.71%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	495,945,200	22.23%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	430,433,100	19.29%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	190,175,050	8.52%
BI	CETES	240912	AAA(mex)	97,493,490	4.37%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	96,075,580	4.31%
	Reportos			819,707,763	36.73%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	509,477,974	22.83%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	237,841,368	10.66%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	72,388,420	3.24%
	TOTAL CARTERA			2,231,490,710	100.00%
	ACTIVO NETO			2,231,060,103	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.006 %

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."