

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			1,076,617,259	28.23%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	1,076,617,259	28.23%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,319,024,940	34.59%
BI	CETES	240801	AAA(mex)	498,021,750	13.06%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	434,025,630	11.38%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	191,760,850	5.03%
BI	CETES	240912	AAA(mex)	98,334,630	2.58%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	96,882,080	2.54%
	Reportos			1,417,788,101	37.18%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,417,788,101	37.18%
	TOTAL CARTERA			3,813,430,300	100.00%
	ACTIVO NETO			3,556,090,502	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.004 %

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."