

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			102,800,553	1.47%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	102,800,553	1.47%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			4,648,729,734	66.51%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,593,886,880	22.81%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,044,903,614	14.95%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	934,875,335	13.38%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	684,749,100	9.80%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	195,692,118	2.80%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	98,809,090	1.41%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	95,813,597	1.37%
	Reportos			2,237,753,058	32.02%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	2,237,753,058	32.02%
	TOTAL CARTERA			6,989,283,345	100.00%
	ACTIVO NETO			6,986,520,913	
	Cartera al:		19/09/2024		

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.005 %

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."