

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			103,616,476	1.37%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	103,616,476	1.37%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			5,580,827,548	73.50%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,666,650,250	21.95%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,052,624,621	13.86%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	942,681,295	12.42%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	834,986,960	11.00%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	690,389,280	9.09%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	197,301,836	2.60%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	99,624,950	1.31%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	96,568,356	1.27%
	Reportos			1,908,483,378	25.14%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	1,908,483,378	25.14%
	TOTAL CARTERA			7,592,927,402	100.00%
	ACTIVO NETO			7,590,259,322	

Cartera al: 17/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.007 %

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."