

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			104,462,893	1.39%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	104,462,893	1.39%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			5,493,387,546	73.28%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,680,289,350	22.42%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,061,488,886	14.16%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	841,824,105	11.23%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	696,073,630	9.29%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	676,737,566	9.03%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	240,687,608	3.21%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	198,908,799	2.65%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,377,602	1.30%
	Reportos			1,898,545,798	25.33%
IS	BPA182	280928	AAA(mex)	801,544,623	10.69%
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	503,192,987	6.71%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	490,911,809	6.55%
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	102,896,379	1.37%
	TOTAL CARTERA			7,496,396,237	100.00%
	ACTIVO NETO			7,494,010,636	

Cartera al: 14/11/2024

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."