

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			104,880,560	1.34%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	104,880,560	1.34%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			5,316,339,978	67.82%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,687,093,770	21.52%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,065,956,859	13.60%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	845,208,890	10.78%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	698,792,570	8.92%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	679,808,358	8.67%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	241,696,041	3.08%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,783,490	1.25%
	Reportos			2,417,493,110	30.84%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	2,365,113,261	30.17%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	52,379,850	0.67%
	TOTAL CARTERA			7,838,713,648	100.00%
	ACTIVO NETO			7,835,522,456	

Cartera al: 28/11/2024

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."