

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/3CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			445,861,039	26.05%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	250,096,185	14.61%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	195,764,854	11.44%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			991,131,735	57.90%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	286,234,500	16.72%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	233,312,750	13.63%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	192,204,360	11.23%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	98,670,000	5.76%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,774,210	2.85%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,235,565	2.64%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,961,185	2.57%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,739,165	2.50%
	Udibonos			49,995,082	2.92%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	49,995,082	2.92%
	Reportos			224,912,848	13.14%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	136,237,773	7.96%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	88,675,075	5.18%
	TOTAL CARTERA			1,711,900,704	100.00%
	ACTIVO NETO			1,720,942,680	

Cartera al: 05/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.032 %

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."