

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			453,817,074	23.18%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	249,516,198	12.74%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	194,631,886	9.94%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,668,991	0.49%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			988,305,905	50.47%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	285,421,110	14.58%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	232,635,500	11.88%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	191,771,620	9.79%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	98,472,800	5.03%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,663,865	2.49%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,038,300	2.30%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,746,990	2.23%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,555,720	2.17%
	Udibonos			50,586,114	2.58%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,586,114	2.58%
	Reportos			465,477,507	23.77%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	465,477,507	23.77%
	TOTAL CARTERA			1,958,186,600	100.00%
	ACTIVO NETO			1,957,799,646	

Cartera al: 28/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.033 %
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."