

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			45,492,394	3.34%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	36,204,020	2.66%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,288,374	0.68%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			970,074,500	71.13%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	213,859,080	15.68%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	199,208,440	14.61%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	99,185,390	7.27%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	95,444,840	7.00%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	92,709,730	6.80%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	92,315,290	6.77%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	89,747,830	6.58%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,598,205	3.34%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,005,695	3.08%
	Udibonos			55,206,720	4.05%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,352,812	3.91%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,853,908	0.14%
	Reportos			293,049,952	21.49%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	255,922,432	18.77%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	37,127,519	2.72%
	TOTAL CARTERA			1,363,823,566	100.00%
	ACTIVO NETO			1,363,694,922	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % **Var Promedio:** 0.021 %

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."