

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			353,878,322	20.02%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	344,381,853	19.48%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,496,469	0.54%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,066,861,565	60.35%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	280,047,480	15.84%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	228,347,275	12.92%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	188,124,340	10.64%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	96,878,280	5.48%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	96,489,020	5.46%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	47,694,700	2.70%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	44,265,225	2.50%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,075,290	2.44%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	41,939,955	2.37%
	Reportos			347,142,300	19.64%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	347,142,300	19.64%
	TOTAL CARTERA			1,767,882,187	100.00%
	ACTIVO NETO			1,767,246,363	
	Cartera al:		19/09/2024		

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.024 %

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."