

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			2,383,504	34.68%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	1,875,202	27.29%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	508,303	7.40%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			3,397,373	49.44%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	3,397,373	49.44%
	Reportos			1,091,569	15.88%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	1,091,569	15.88%
	TOTAL CARTERA			6,872,446	100.00%
	ACTIVO NETO			6,901,318	
	Cartera al:	20/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.200 % Var Promedio: 0.102 %

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."