

CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			119,318,035	99.45%
1ISP	SHV	*	Alta	119,318,035	99.45%
	Reportos			656,350	0.55%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	656,350	0.55%
	TOTAL CARTERA			119,974,385	100.00%
	ACTIVO NETO			121,538,508	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 2.500 % Var Promedio: 0.939 %

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."