

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			623,110,210	87.53%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	428,098,950	60.14%
BI	CETES	240620	AAA(mex)	99,481,000	13.98%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	95,530,260	13.42%
	Reportos			88,740,072	12.47%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	88,740,072	12.47%
	TOTAL CARTERA			711,850,282	100.00%
	ACTIVO NETO			711,707,161	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.005 %

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."