

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			101,986,973	5.05%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	101,986,973	5.05%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,314,154,495	65.03%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	497,417,850	24.61%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	431,807,040	21.37%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	190,771,545	9.44%
BI	CETES	240912	AAA(mex)	97,790,200	4.84%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	96,367,860	4.77%
	Reportos			604,720,448	29.92%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	604,720,448	29.92%
	TOTAL CARTERA			2,020,861,916	100.00%
	ACTIVO NETO			2,020,247,663	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.006 %

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."