

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			1,713,453,570	28.26%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	1,611,253,412	26.57%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	102,200,158	1.69%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			2,455,189,503	40.49%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,037,809,713	17.12%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	929,625,160	15.33%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	194,567,091	3.21%
BI	CETES	240912	AAA(mex)	99,698,850	1.64%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	98,269,800	1.62%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	95,218,889	1.57%
	Reportos			1,894,632,761	31.25%
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	1,894,632,761	31.25%
	TOTAL CARTERA			6,063,275,834	100.00%
	ACTIVO NETO			6,060,663,788	
	Cartera al:	30/08/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.003 %

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."

