

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			103,151,621	1.25%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	103,151,621	1.25%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			6,323,515,892	76.69%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,658,873,770	20.12%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	1,599,528,960	19.40%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,048,106,462	12.71%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	938,182,760	11.38%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	687,126,510	8.33%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	196,376,978	2.38%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	99,177,110	1.20%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	96,143,342	1.17%
	Reportos			1,819,027,180	22.06%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	1,429,327,027	17.33%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	389,700,152	4.73%
	TOTAL CARTERA			8,245,694,693	100.00%
	ACTIVO NETO			6,582,947,596	
	Cartera al:	30/09/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.004 %

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."