

CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			505,457	6.19%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	505,457	6.19%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot			7,069,337	86.60%
IISP	SHV	*	Alta	7,069,337	86.60%
	Reportos			588,825	7.21%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	588,825	7.21%
	TOTAL CARTERA			8,163,619	100.00%
	ACTIVO NETO			8,187,318	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 2.500 % Var Promedio: 0.044 %

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."