

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			554,440,753	31.52%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	509,934,865	28.99%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	35,066,212	1.99%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,439,675	0.54%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,088,328,148	61.88%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	271,903,170	15.46%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	217,721,543	12.38%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	182,644,180	10.39%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	97,170,970	5.53%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,372,220	5.37%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,973,850	5.34%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,415,675	2.64%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,692,480	2.43%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,434,060	2.36%
	Udibonos			53,478,435	3.04%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,478,435	3.04%
	Reportos			62,546,830	3.56%
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	62,546,830	3.56%
	TOTAL CARTERA			1,758,794,166	100.00%
	ACTIVO NETO			1,760,933,488	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.028 %
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."