

DISCRECIONAL

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			497,680	7.11%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	497,680	7.11%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			5,026,315	71.81%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	5,026,315	71.81%
	Reportos			1,475,584	21.08%
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,475,584	21.08%
	TOTAL CARTERA			6,999,579	100.00%
	ACTIVO NETO			7,039,511	

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.500 % Var Promedio: 0.090 %

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."