

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/3CP

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|--|-------------------|------------|------------------|----------------|
| | Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija | | | 2,354,936 | 34.51% |
| M | BONOS | 260305 | AAA(mex) | 1,858,730 | 27.24% |
| M | BONOS | 240905 | AAA(mex) | 496,206 | 7.27% |
| | Certificados De La Tesorería De La Federación | | | 3,360,987 | 49.26% |
| BI | CETES | 251224 | AAA(mex) | 3,360,987 | 49.26% |
| | Reportos | | | 1,107,422 | 16.23% |
| LD | BONDESD | 251211 | AAA(mex) | 1,107,422 | 16.23% |
| | TOTAL CARTERA | | | 6,823,344 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 6,859,009 | |
| | Cartera al: | 27/03/2024 | | | |

Límite Máximo de VaR: 0.200 % Var Promedio: 0.119 %
 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."