

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			104,031,362	1.40%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	104,031,362	1.40%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			5,502,894,960	73.82%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,673,114,840	22.45%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,056,723,398	14.18%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	946,406,150	12.70%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	838,319,385	11.25%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	693,251,090	9.30%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	198,129,346	2.66%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	96,950,751	1.30%
	Reportos			1,847,324,063	24.78%
IM	BPAG28	250206	AAA(mex)	889,989,371	11.94%
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	716,510,672	9.61%
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	240,824,019	3.23%
	TOTAL CARTERA			7,454,250,385	100.00%
	ACTIVO NETO			7,450,755,400	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.007 %

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."