

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			796,778,329	41.10%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	348,505,063	17.98%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	247,235,320	12.75%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	191,497,398	9.88%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,540,549	0.49%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			978,547,105	50.48%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	282,789,090	14.59%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	230,196,500	11.87%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	189,996,680	9.80%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,634,190	5.04%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,237,975	2.49%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	44,502,115	2.30%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,206,635	2.23%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	41,983,920	2.17%
	Udibonos			50,031,327	2.58%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,031,327	2.58%
	Reportos			113,235,336	5.84%
IM	BPAG28	270204	AAA(mex)	113,235,336	5.84%
	TOTAL CARTERA			1,938,592,097	100.00%
	ACTIVO NETO			1,938,117,093	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.032 %
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."