

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			101,890,729	4.11%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	101,890,729	4.11%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,312,978,006	52.98%
BI	CETES	240718	AAA(mex)	496,975,550	20.05%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	431,413,425	17.41%
BI	CETES	241128	AAA(mex)	190,602,201	7.69%
BI	CETES	240912	AAA(mex)	97,704,430	3.94%
BI	CETES	241031	AAA(mex)	96,282,400	3.89%
	Reportos			1,063,551,629	42.91%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,063,551,629	42.91%
	TOTAL CARTERA			2,478,420,364	100.00%
	ACTIVO NETO			2,477,919,329	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.006 %

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."