

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			4,771,243,515	55.61%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,697,095,720	19.78%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,072,471,329	12.50%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	975,981,600	11.38%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	684,167,362	7.97%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	243,155,949	2.83%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	98,371,555	1.15%
	Reportos			3,808,431,620	44.39%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	3,246,063,010	37.83%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	424,505,626	4.95%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	137,862,984	1.61%
	TOTAL CARTERA			8,579,675,135	100.00%
	ACTIVO NETO			7,600,270,262	

Cartera al: **19/12/2024**

Límite Máximo de VaR: **0.050 %** Var Promedio: **0.004 %**

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."