

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			195,769,508	12.70%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	195,769,508	12.70%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			995,098,450	64.54%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	287,417,490	18.64%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	234,309,825	15.20%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	193,001,280	12.52%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	99,065,010	6.43%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,964,245	3.18%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,389,455	2.94%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,086,555	2.86%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,864,590	2.78%
	Udibonos			50,004,798	3.24%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,004,798	3.24%
	Reportos			301,079,416	19.53%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	215,004,424	13.94%
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	86,074,992	5.58%
	TOTAL CARTERA			1,541,952,172	100.00%
	ACTIVO NETO			1,541,278,276	
	Cartera al:	19/12/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.035 %

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."