

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			197,386,834	13.36%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	197,386,834	13.36%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,143,915,945	77.40%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	289,634,940	19.60%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	236,105,175	15.98%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	194,527,280	13.16%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	142,716,120	9.66%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	98,309,660	6.65%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,341,320	3.34%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,717,200	3.09%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,386,565	3.00%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	43,177,685	2.92%
	Udibonos			50,432,217	3.41%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,432,217	3.41%
	Reportos			86,233,624	5.84%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	86,233,624	5.84%
	TOTAL CARTERA			1,477,968,620	100.00%
	ACTIVO NETO			1,477,427,134	

Cartera al: 16/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.034 %

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."