

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			553,910,867	31.45%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	509,453,645	28.92%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	35,031,499	1.99%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,425,723	0.54%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,087,259,338	61.73%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	271,570,230	15.42%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	217,534,253	12.35%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	182,514,080	10.36%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	97,086,000	5.51%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	94,289,890	5.35%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,889,860	5.33%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,375,390	2.63%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,641,520	2.42%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,358,115	2.35%
	Udibonos			55,239,468	3.14%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,391,073	3.03%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,848,395	0.11%
	Reportos			65,044,909	3.69%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	65,044,909	3.69%
	TOTAL CARTERA			1,761,454,582	100.00%
	ACTIVO NETO			1,761,448,227	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.028 %

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."