

MEDIANO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			2,724,984	34.60%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	2,235,935	28.39%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	489,049	6.21%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,822,004	35.83%
91	TPLAYCB	24	HR AA	2,822,004	35.83%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			1,800,571	22.86%
93	ELEKTRA	00224	HR1	1,800,571	22.86%
	Reportos			528,341	6.71%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	528,341	6.71%
	TOTAL CARTERA			7,875,900	100.00%
	ACTIVO NETO			7,886,474	
	Cartera al:	19/12/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.200 % Var Promedio: 0.057 %

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."