

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			104,967,938	1.36%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	104,967,938	1.36%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			5,321,019,396	68.79%
BI	CETES	241226	AAA(mex)	1,688,600,140	21.83%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,066,888,355	13.79%
BI	CETES	241219	AAA(mex)	845,903,255	10.94%
BI	CETES	241205	AAA(mex)	699,386,590	9.04%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	680,473,379	8.80%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	241,901,093	3.13%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	97,866,585	1.27%
	Reportos			2,309,297,677	29.85%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	1,507,079,708	19.48%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	802,217,969	10.37%
	TOTAL CARTERA			7,735,285,011	100.00%
	ACTIVO NETO			7,731,562,220	

Cartera al: 29/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.006 %

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."

