

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			500,660	45.49%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	500,660	45.49%
	Reportos			600,049	54.52%
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	600,049	54.52%
	TOTAL CARTERA			1,100,709	100.00%
	ACTIVO NETO			1,130,241	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.500 % Var Promedio: 0.091 %

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."