

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			551,357,632	29.59%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	505,457,385	27.12%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	36,531,921	1.96%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,368,326	0.50%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,079,395,473	57.92%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	269,664,960	14.47%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	215,853,278	11.58%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	181,191,380	9.72%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	96,345,490	5.17%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	93,574,760	5.02%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	93,186,900	5.00%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	46,020,315	2.47%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,400,370	2.28%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	41,158,020	2.21%
	Udibonos			55,675,881	2.99%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	53,762,461	2.89%
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	1,913,420	0.10%
	Reportos			177,057,962	9.50%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	177,057,962	9.50%
	TOTAL CARTERA			1,863,486,948	100.00%
	ACTIVO NETO			1,863,240,740	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.023 %

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."