

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			454,441,282	23.13%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	249,785,895	12.71%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	194,971,960	9.92%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,683,427	0.49%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			989,386,930	50.35%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	285,734,100	14.54%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	232,865,100	11.85%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	191,959,220	9.77%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	98,556,480	5.02%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	48,709,075	2.48%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,098,575	2.30%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,822,275	2.23%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,642,105	2.17%
	Udibonos			50,658,029	2.58%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,658,029	2.58%
	Reportos			470,515,126	23.95%
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	200,277,150	10.19%
LD	BONDES	260611	AAA(mex)	165,502,925	8.42%
LF	BONDES	310320	AAA(mex)	104,735,051	5.33%
	TOTAL CARTERA			1,965,001,367	100.00%
	ACTIVO NETO			1,964,494,168	

Cartera al: 29/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.033 %

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."