

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			196,111,414	11.81%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	196,111,414	11.81%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,095,868,995	66.01%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	288,327,330	17.37%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	234,911,550	14.15%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	193,693,220	11.67%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	99,417,010	5.99%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	97,892,960	5.90%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,134,220	2.96%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,475,950	2.74%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,141,880	2.66%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,874,875	2.58%
	Udibonos			50,226,735	3.03%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,226,735	3.03%
	Reportos			317,957,993	19.15%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	317,957,993	19.15%
	TOTAL CARTERA			1,660,165,137	100.00%
	ACTIVO NETO			1,561,735,760	

Cartera al: 31/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.036 %

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."