

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			14,813,742	82.03%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	14,813,742	82.03%
	Reportos			3,246,299	17.98%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	3,246,299	17.98%
	TOTAL CARTERA			18,060,041	100.00%
	ACTIVO NETO			18,103,779	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.004 %

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."