

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Corto Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Reportos			8,511,109,381	100.00%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	3,143,123,473	36.93%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	824,058,984	9.68%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	1,189,641,893	13.98%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	305,336,413	3.59%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	1,058,187,760	12.43%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	508,611,763	5.98%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	50,889,629	0.60%
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	86,954,782	1.02%
LD	BONDESD	260212	AAA(mex)	162,250,074	1.91%
LF	BONDES F	261001	AAA(mex)	900,281,240	10.58%
LF	BONDES F	290322	AAA(mex)	219,795,046	2.58%
LF	BONDES F	290419	AAA(mex)	61,978,323	0.73%
	TOTAL CARTERA			8,511,109,381	100.00%
	ACTIVO NETO			8,500,792,293	

Cartera al: 25/Ene/2024
Límite Máximo de VaR: 0.03%
Var Promedio: 0.0004%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV