



+TASA

HR AAA/1CP

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			9,288,202,074	100.00%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	414,624,713	4.46%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	1,500,443,746	16.15%
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	3,807,322,096	40.99%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	502,531,644	5.41%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	18,607,962	0.20%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	183,926,037	1.98%
IS	BPA182	280928	AAA(mex)	494,335,143	5.32%
IS	BPA182	290927	AAA(mex)	399,361,293	4.30%
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	116,033,473	1.25%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	350,954,785	3.78%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	499,762,672	5.38%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	500,149,275	5.39%
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	500,149,236	5.39%
	TOTAL CARTERA			9,288,202,074	100.00%
	ACTIVO NETO			9,272,880,038	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.03%

Var Promedio:

0.0000%

Parametros: 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