

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				6,291,556,796	70.24%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	988,977,100	11.04%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	976,970,400	10.91%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	790,053,120	8.82%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	783,194,271	8.74%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	539,137,361	6.02%
BI	CETES	250828	AAA(mex)	499,588,570	5.58%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	497,679,350	5.56%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	482,702,300	5.39%
BI	CETES	250814	AAA(mex)	475,020,402	5.30%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	258,233,922	2.88%
Reportos				2,666,214,072	29.76%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	2,022,829,469	22.58%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	377,987,330	4.22%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	265,397,273	2.96%
TOTAL CARTERA				8,957,770,868	100.00%
ACTIVO NETO				8,952,741,975	

Cartera al: 05/06/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.015 %

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."