

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				7,697,116,215	87.70%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,929,805,841	21.99%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,830,414,924	20.85%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,495,833,450	17.04%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	799,517,245	9.11%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	551,516,406	6.28%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	492,721,450	5.61%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	323,815,967	3.69%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	263,633,968	3.00%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,856,964	0.11%
Reportos				1,080,012,210	12.31%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	782,526,546	8.92%
M	BONOS	360221	AAA(mex)	130,467,976	1.49%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	101,197,351	1.15%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	65,820,337	0.75%
TOTAL CARTERA				8,777,128,425	100.00%
ACTIVO NETO				8,771,900,784	

Cartera al:

04/09/2025

Límite Máximo de VaR:

0.050 % Var Promedio: 0.017 %

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."