

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			348,956,881	15.24%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	348,956,881	15.24%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,716,276,540	74.93%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	373,310,560	16.30%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	296,693,130	12.95%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	245,756,075	10.73%
BI	CETES	250904	AAA(mex)	196,011,180	8.56%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	194,224,620	8.48%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	134,916,690	5.89%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	94,199,790	4.11%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	87,828,070	3.83%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	47,831,980	2.09%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	45,504,445	1.99%
	Reportos			225,245,623	9.83%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	225,245,623	9.83%
	TOTAL CARTERA			2,290,479,044	100.00%
	ACTIVO NETO			2,190,113,219	
	Cartera al:	05/06/2025			

Límite Máximo de VaR:

0.100 % Var Promedio: 0.039 %

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."