

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			643,873,815	23.58%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	643,873,815	23.58%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,781,051,125	65.21%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	620,151,610	22.71%
BI	CETES	260401	AAA(mex)	478,518,400	17.52%
BI	CETES	270513	AAA(mex)	175,717,760	6.43%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	138,162,705	5.06%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	96,268,240	3.53%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	89,958,550	3.29%
BI	CETES	270708	AAA(mex)	86,800,730	3.18%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	48,852,185	1.79%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	46,620,945	1.71%
	Reportos			306,248,340	11.21%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	209,166,400	7.66%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	97,081,940	3.56%
	TOTAL CARTERA			2,731,173,280	100.00%
	ACTIVO NETO			2,730,385,369	

Cartera al:

04/09/2025

Límite Máximo de VaR:

0.100 % Var Promedio: 0.043 %

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."