

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				7,690,140,775	90.51%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,928,039,681	22.69%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,828,656,129	21.52%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,494,557,100	17.59%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	798,873,752	9.40%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	550,881,214	6.48%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	492,353,050	5.80%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	323,509,533	3.81%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	263,421,446	3.10%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,848,870	0.12%
Reportos				806,430,365	9.49%
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	585,138,029	6.89%
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	221,292,336	2.60%
TOTAL CARTERA				8,496,571,140	100.00%
ACTIVO NETO				8,492,165,885	

Cartera al: 29/08/2025

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."