

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				7,639,891,323	88.54%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,965,785,654	22.78%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,864,170,382	21.60%
BI	CETES	261015	AAA(mex)	1,047,669,982	12.14%
BI	CETES	251231	AAA(mex)	993,470,400	11.51%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	680,556,170	7.89%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	562,008,368	6.51%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	329,796,467	3.82%
BI	CETES	260226	AAA(mex)	196,433,900	2.28%
Reportos				988,779,958	11.46%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	988,779,958	11.46%
TOTAL CARTERA				8,628,671,281	100.00%
ACTIVO NETO				8,625,146,680	

Cartera al: 27/11/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.014 %

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."