

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				4,881,788,385	58.64%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,484,098,950	17.83%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	793,047,558	9.53%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	546,274,019	6.56%
BI	CETES	250828	AAA(mex)	505,983,486	6.08%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	488,749,000	5.87%
BI	CETES	250814	AAA(mex)	481,084,748	5.78%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	321,029,417	3.86%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	261,521,207	3.14%
Reportos				3,442,718,405	41.36%
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	1,868,997,028	22.45%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,573,721,377	18.91%
TOTAL CARTERA				8,324,506,790	100.00%
ACTIVO NETO				8,320,154,230	

Cartera al: 31/07/2025

Límite Máximo de VaR:

0.050 % Var Promedio: 0.009 %

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."