

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				3,091,869,693	33.95%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,078,811,021	11.85%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	981,355,300	10.78%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	688,192,508	7.56%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	244,567,440	2.69%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	98,943,424	1.09%
Reportos				6,015,323,512	66.05%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	3,912,250,279	42.96%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	1,118,157,681	12.28%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	562,594,633	6.18%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	422,320,919	4.64%
TOTAL CARTERA				9,107,193,205	100.00%
ACTIVO NETO				9,105,588,413	

Cartera al: 09/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.005 %

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."