

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				4,548,921,907	48.13%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	1,958,559,400	20.72%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	996,583,000	10.55%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	894,484,207	9.47%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	699,295,301	7.40%
Reportos				4,901,793,072	51.87%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	1,113,658,112	11.78%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	1,069,318,450	11.32%
IM	BPAG28	270805	AAA(mex)	1,002,248,508	10.61%
IM	BPAG28	280203	AAA(mex)	896,355,509	9.49%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	595,356,880	6.30%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	149,708,958	1.58%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	75,146,657	0.80%
TOTAL CARTERA				9,450,714,979	100.00%
ACTIVO NETO				9,445,527,364	

Cartera al: 06/03/2025

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."