

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				7,700,393,094	92.21%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	1,990,415,200	23.84%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	982,457,900	11.77%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	969,963,000	11.62%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	908,990,961	10.89%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	784,761,600	9.40%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	777,650,346	9.31%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	535,252,074	6.41%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	494,458,950	5.92%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	256,443,064	3.07%
Reportos				650,514,329	7.79%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	650,514,329	7.79%
TOTAL CARTERA				8,350,907,423	100.00%
ACTIVO NETO				8,349,504,428	

Cartera al: 08/05/2025

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."