

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				6,281,494,907	73.94%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	987,377,800	11.62%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	975,429,400	11.48%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	788,805,600	9.29%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	781,938,577	9.20%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	538,331,807	6.34%
BI	CETES	250828	AAA(mex)	498,812,701	5.87%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	496,831,050	5.85%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	481,888,850	5.67%
BI	CETES	250814	AAA(mex)	474,268,137	5.58%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	257,810,985	3.04%
Reportos				2,213,749,132	26.06%
LF	BONDESF	291101	AAA(mex)	1,072,931,440	12.63%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	663,028,556	7.81%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	262,687,316	3.09%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	215,101,819	2.53%
TOTAL CARTERA				8,495,244,039	100.00%
ACTIVO NETO				8,491,606,993	

Cartera al: 29/05/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % **Var Promedio:** 0.016 %

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."