

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				5,353,233,009	59.06%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,482,335,550	16.35%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	798,935,840	8.81%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	791,977,516	8.74%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	545,342,505	6.02%
BI	CETES	250828	AAA(mex)	505,241,972	5.57%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	487,963,550	5.38%
BI	CETES	250814	AAA(mex)	480,344,207	5.30%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	261,091,869	2.88%
Reportos				3,710,852,610	40.94%
LF	BONDESF	280420	AAA(mex)	2,100,741,395	23.18%
LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	1,610,111,214	17.76%
TOTAL CARTERA				9,064,085,619	100.00%
ACTIVO NETO				9,059,218,752	

Cartera al: 24/07/2025

Límite Máximo de VaR:

0.050 % Var Promedio: 0.010 %

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."