

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				7,685,236,590	88.14%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,926,747,441	22.10%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,827,537,153	20.96%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,493,551,500	17.13%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	798,382,120	9.16%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	550,553,011	6.31%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	492,046,400	5.64%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	323,320,204	3.71%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	263,255,894	3.02%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,842,868	0.11%
Reportos				1,033,750,354	11.86%
IS	BPA182	310918	AAA(mex)	671,299,688	7.70%
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	362,450,666	4.16%
TOTAL CARTERA				8,718,986,944	100.00%
ACTIVO NETO				8,715,196,039	

Cartera al: 28/08/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.014 %

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."