

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				7,478,557,044	87.48%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,948,685,523	22.80%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,848,000,235	21.62%
BI	CETES	261015	AAA(mex)	1,039,679,101	12.16%
BI	CETES	251231	AAA(mex)	984,880,300	11.52%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	557,233,650	6.52%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	497,199,500	5.82%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	326,936,560	3.82%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	265,996,672	3.11%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,945,502	0.12%
Reportos				1,069,956,266	12.52%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	853,869,548	9.99%
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	169,425,873	1.98%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	46,660,846	0.55%
TOTAL CARTERA				8,548,513,310	100.00%
ACTIVO NETO				8,548,705,752	

Cartera al: 16/10/2025

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."