

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				8,166,504,879	95.73%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,951,740,324	22.88%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,850,978,753	21.70%
BI	CETES	261015	AAA(mex)	1,041,573,891	12.21%
BI	CETES	251231	AAA(mex)	986,343,500	11.56%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	675,922,940	7.92%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	558,124,008	6.54%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	498,006,150	5.84%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	327,466,301	3.84%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	266,388,402	3.12%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,960,609	0.12%
Reportos				364,705,875	4.28%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	364,705,875	4.28%
TOTAL CARTERA				8,531,210,754	100.00%
ACTIVO NETO				8,529,999,606	
Cartera al:				23/10/2025	

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."