

CORTO PLAZO					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			195,799,652	12.88%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	195,799,652	12.88%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			996,407,135	65.53%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	287,841,570	18.93%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	234,529,275	15.42%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	193,383,380	12.72%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	99,260,560	6.53%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,056,920	3.23%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	45,398,415	2.99%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,090,100	2.90%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	42,846,915	2.82%
	Udibonos			50,106,346	3.30%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,106,346	3.30%
	Reportos			278,341,376	18.30%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	178,222,841	11.72%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	100,118,535	6.58%
	TOTAL CARTERA			1,520,654,509	100.00%
	ACTIVO NETO			1,519,741,299	
	Cartera al:	26/12/2024			

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.036 %

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."