

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,713,273,320	75.75%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	372,591,840	16.47%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	296,213,340	13.10%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	245,366,850	10.85%
BI	CETES	250904	AAA(mex)	195,707,580	8.65%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	193,913,220	8.57%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	134,655,120	5.95%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	94,018,650	4.16%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	87,625,290	3.87%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	47,749,165	2.11%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	45,432,265	2.01%
Reportos				548,466,444	24.25%
IM	BPAG28	270805	AAA(mex)	324,168,939	14.33%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	224,297,505	9.92%
TOTAL CARTERA				2,261,739,764	100.00%
ACTIVO NETO				2,261,379,201	

Cartera al: 29/05/2025

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.031 %

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."