

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			651,488,026	24.07%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	651,488,026	24.07%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,525,456,005	56.35%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	374,917,400	13.85%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	246,958,975	9.12%
BI	CETES	250904	AAA(mex)	196,957,340	7.28%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	195,179,380	7.21%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	135,511,200	5.01%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	99,403,210	3.67%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	94,605,350	3.50%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	88,145,990	3.26%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	48,056,155	1.78%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	45,721,005	1.69%
	Reportos			530,029,781	19.58%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	530,029,781	19.58%
	TOTAL CARTERA			2,706,973,812	100.00%
	ACTIVO NETO			2,705,816,662	

Cartera al:

26/06/2025

Límite Máximo de VaR:

0.100 % Var Promedio: 0.037 %

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."