

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				655,523,031	25.06%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	655,523,031	25.06%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,435,428,405	54.87%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	377,494,880	14.43%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	248,516,150	9.50%
BI	CETES	250904	AAA(mex)	198,238,980	7.58%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	196,402,780	7.51%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	136,401,420	5.21%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	95,255,940	3.64%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	88,719,950	3.39%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	48,360,370	1.85%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	46,037,935	1.76%
Reportos				525,294,893	20.08%
IM	BPAG28	270805	AAA(mex)	525,294,893	20.08%
TOTAL CARTERA				2,616,246,329	100.00%
ACTIVO NETO				2,615,041,085	

Cartera al: 24/07/2025

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."