

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				661,699,428	20.52%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	661,699,428	20.52%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,777,695,760	55.14%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	619,070,530	19.20%
BI	CETES	260401	AAA(mex)	477,690,700	14.82%
BI	CETES	270513	AAA(mex)	175,263,200	5.44%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	137,898,405	4.28%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	96,097,830	2.98%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	89,764,470	2.78%
BI	CETES	270708	AAA(mex)	86,596,570	2.69%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	48,771,565	1.51%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	46,542,490	1.44%
Reportos				784,796,380	24.34%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	567,916,229	17.61%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	216,880,152	6.73%
TOTAL CARTERA				3,224,191,568	100.00%
ACTIVO NETO				2,707,418,922	
Cartera al:		28/08/2025			

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."