

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/1CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			3,013,798,140	33.83%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,086,175,489	12.19%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	988,130,700	11.09%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	693,231,066	7.78%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	246,260,885	2.77%
	Reportos			5,893,952,218	66.17%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	4,961,792,856	55.70%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	932,159,361	10.47%
	TOTAL CARTERA			8,907,750,358	100.00%
	ACTIVO NETO			8,902,941,693	

Cartera al: 31/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.004 %

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."