

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				7,220,026,898	77.31%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,941,709,231	20.79%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,841,377,297	19.72%
BI	CETES	251231	AAA(mex)	981,467,400	10.51%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	803,962,821	8.61%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	555,096,212	5.94%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	495,552,700	5.31%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	325,763,774	3.49%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	265,183,072	2.84%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,914,391	0.11%
Reportos				2,119,581,642	22.70%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	1,522,482,654	16.30%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	597,098,988	6.39%
TOTAL CARTERA				9,339,608,540	100.00%
ACTIVO NETO				8,353,647,928	
Cartera al:				30/09/2025	

Límite Máximo de VaR:

0.050 % Var Promedio: 0.015 %

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."