

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				3,097,586,025	33.51%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,080,736,854	11.69%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	983,096,600	10.64%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	689,576,856	7.46%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	245,040,771	2.65%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	99,134,944	1.07%
Reportos				6,145,633,775	66.49%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	4,583,560,541	49.59%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	1,405,973,566	15.21%
IM	BPAG28	271104	AAA(mex)	156,097,751	1.69%
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,917	0.00%
TOTAL CARTERA				9,243,219,800	100.00%
ACTIVO NETO				9,240,142,797	

Cartera al: 16/01/2025

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."