

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			2,581,088,094	25.86%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	992,962,000	9.95%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	891,371,838	8.93%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	696,754,256	6.98%
	Reportos			7,401,571,807	74.14%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	2,491,476,399	24.96%
LF	BONDESF	291101	AAA(mex)	2,308,923,723	23.13%
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	1,015,056,354	10.17%
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	870,512,028	8.72%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	704,917,962	7.06%
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	10,685,341	0.11%
	TOTAL CARTERA			9,982,659,901	100.00%
	ACTIVO NETO			9,978,611,303	

Cartera al: 20/02/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.003 %

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."