

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				6,342,777,509	71.42%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,479,754,950	16.66%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	998,671,800	11.25%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	797,695,840	8.98%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	790,673,756	8.90%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	544,127,480	6.13%
BI	CETES	250828	AAA(mex)	504,382,073	5.68%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	487,192,950	5.49%
BI	CETES	250814	AAA(mex)	479,591,458	5.40%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	260,687,203	2.94%
Reportos				2,538,396,088	28.58%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	780,229,346	8.79%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	701,008,554	7.89%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	650,701,704	7.33%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	406,456,483	4.58%
TOTAL CARTERA				8,881,173,597	100.00%
ACTIVO NETO				8,877,767,520	

Cartera al:

17/07/2025

Límite Máximo de VaR:

0.050 % Var Promedio: 0.010 %

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."