

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				7,709,954,397	87.39%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,933,183,252	21.91%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,833,499,669	20.78%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,498,074,750	16.98%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	800,783,504	9.08%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	552,615,615	6.26%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	493,492,100	5.59%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	324,368,582	3.68%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	264,064,266	2.99%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,872,660	0.11%
Reportos				1,112,770,547	12.61%
IS	BPA182	320324	AAA(mex)	621,936,190	7.05%
IM	BPAG28	270204	AAA(mex)	490,834,356	5.56%
TOTAL CARTERA				8,822,724,944	100.00%
ACTIVO NETO				8,820,404,330	

Cartera al: 11/09/2025

Límite Máximo de VaR:

0.050 % Var Promedio: 0.016 %

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."