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				7,222,764,242	84.48%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	1,942,495,768	22.72%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	1,842,058,889	21.55%
BI	CETES	251231	AAA(mex)	981,799,800	11.48%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	804,273,479	9.41%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	555,350,161	6.50%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	495,765,350	5.80%
BI	CETES	260122	AAA(mex)	325,877,012	3.81%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	265,227,027	3.10%
BI	CETES	251106	AAA(mex)	9,916,756	0.12%
Reportos				1,326,595,114	15.52%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	987,459,158	11.55%
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	339,135,956	3.97%
TOTAL CARTERA				8,549,359,356	100.00%
ACTIVO NETO				8,544,670,303	

Cartera al: 02/10/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.014 %

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."