

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,157,004,570	76.29%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	292,705,830	19.30%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	238,924,150	15.76%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	196,552,000	12.96%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	144,324,690	9.52%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	99,296,200	6.55%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,829,935	3.29%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	46,351,600	3.06%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	45,102,725	2.97%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	43,917,440	2.90%
	Udibonos			51,133,293	3.37%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	51,133,293	3.37%
	Reportos			308,387,027	20.34%
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	308,387,027	20.34%
	TOTAL CARTERA			1,516,524,890	100.00%
	ACTIVO NETO			1,515,905,000	

Cartera al: 20/02/2025

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.015 %

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."