

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			1,446,507,635	88.02%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	295,420,980	17.98%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	291,459,270	17.74%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	241,287,450	14.68%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	198,363,500	12.07%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	190,558,560	11.60%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	92,268,330	5.61%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	46,923,310	2.86%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	45,687,655	2.78%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	44,538,580	2.71%
	Udibonos			51,973,633	3.16%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	51,973,633	3.16%
	Reportos			144,924,982	8.82%
IQ	BPAG91	290111	AAA(mex)	144,924,982	8.82%
	TOTAL CARTERA			1,643,406,250	100.00%
	ACTIVO NETO			1,642,749,827	

Cartera al:

27/03/2025

Límite Máximo de VaR:

0.100 % 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."