

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			645,184,001	23.52%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	645,184,001	23.52%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,785,516,325	65.08%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	621,438,675	22.65%
BI	CETES	260401	AAA(mex)	479,493,450	17.48%
BI	CETES	270513	AAA(mex)	176,431,860	6.43%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	138,603,600	5.05%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	96,443,270	3.52%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	90,241,040	3.29%
BI	CETES	270708	AAA(mex)	87,200,850	3.18%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	48,933,270	1.78%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	46,730,310	1.70%
	Reportos			313,006,818	11.41%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	203,669,162	7.42%
IM	BPAG28	280803	AAA(mex)	109,337,656	3.99%
	TOTAL CARTERA			2,743,707,144	100.00%
	ACTIVO NETO			2,743,137,986	

Cartera al: 11/09/2025

Límite Máximo de VaR:

0.100 % Var Promedio: 0.042 %

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."