

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			648,504,792	21.38%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	648,504,792	21.38%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			2,114,736,350	69.71%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	624,494,585	20.58%
BI	CETES	260401	AAA(mex)	481,835,600	15.88%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	317,533,020	10.47%
BI	CETES	270513	AAA(mex)	177,281,600	5.84%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	139,284,060	4.59%
BI	CETES	260305	AAA(mex)	96,903,040	3.19%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	93,638,120	3.09%
BI	CETES	270708	AAA(mex)	87,648,970	2.89%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	49,163,485	1.62%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	46,953,870	1.55%
	Reportos			270,593,288	8.92%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	270,593,288	8.92%
	TOTAL CARTERA			3,033,834,430	100.00%
	ACTIVO NETO			3,058,685,822	

Cartera al:

02/10/2025

Límite Máximo de VaR:

0.100 % Var Promedio: 0.043 %

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."