

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				3,084,563,167	40.89%
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,076,277,719	14.27%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	978,929,600	12.98%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	686,620,210	9.10%
BI	CETES	250206	AAA(mex)	244,014,548	3.24%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	98,721,091	1.31%
Reportos				4,458,461,214	59.11%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	4,322,451,535	57.30%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	136,009,678	1.80%
TOTAL CARTERA				7,543,024,381	100.00%
ACTIVO NETO				7,539,026,334	

Cartera al: 31/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.004 %

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."