

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				7,686,681,727	94.73%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	1,986,896,800	24.49%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	980,832,600	12.09%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	968,073,900	11.93%
BI	CETES	250515	AAA(mex)	907,412,610	11.18%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	783,392,080	9.66%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	776,334,327	9.57%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	534,197,150	6.58%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	493,594,200	6.08%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	255,948,060	3.15%
Reportos				427,389,172	5.27%
IM	BPAG28	271104	AAA(mex)	427,389,172	5.27%
TOTAL CARTERA				8,114,070,899	100.00%
ACTIVO NETO				8,109,792,750	

Cartera al: 30/04/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.009 %

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."