

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				6,318,273,385	77.75%
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,473,866,700	18.14%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	994,887,700	12.24%
BI	CETES	250731	AAA(mex)	794,682,240	9.78%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	787,614,120	9.69%
BI	CETES	260430	AAA(mex)	542,023,256	6.67%
BI	CETES	250828	AAA(mex)	502,426,520	6.18%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	485,330,850	5.97%
BI	CETES	250814	AAA(mex)	477,757,980	5.88%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	259,684,020	3.20%
Reportos				1,808,303,685	22.25%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	973,160,106	11.98%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	743,432,730	9.15%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	66,748,175	0.82%
M	BONOS	471107	AAA(mex)	24,962,675	0.31%
TOTAL CARTERA				8,126,577,070	100.00%
ACTIVO NETO				8,122,516,655	

Cartera al: 30/06/2025

Límite Máximo de VaR: 0.050 % Var Promedio: 0.013 %

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."

