

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,150,386,705	77.79%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	291,159,870	19.69%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	237,454,525	16.06%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	195,558,120	13.23%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	143,503,950	9.70%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	98,813,070	6.68%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,589,645	3.35%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	46,050,940	3.11%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,728,600	3.03%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	43,527,985	2.94%
	Udibonos			50,784,230	3.43%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	50,784,230	3.43%
	Reportos			277,584,356	18.77%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	277,584,356	18.77%
	TOTAL CARTERA			1,478,755,291	100.00%
	ACTIVO NETO			1,478,267,806	

Cartera al: 31/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.031 %

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."