

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
HR Ratings de México, S.A. De C.V.
Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,990,396,109	22.15%
1ISP	IB01	N	Alta	1,006,901,640	11.21%
1ISP	U03A	N	Alta	919,064,624	10.23%
1ISP	VDST	N	Alta	64,429,844	0.72%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				1,328,895,401	14.79%
FSP	BACMEXT	D25006	F1+ (mex)	166,681,004	1.86%
FSP	BACMEXT	D25007	F1+ (mex)	169,624,004	1.89%
FSP	NAFIN	D25034	F1+ (mex)	169,012,688	1.88%
FSP	NAFIN	D25037	F1+ (mex)	169,779,455	1.89%
FSP	NAFIN	D25039	F1+ (mex)	169,563,698	1.89%
FSP	NAFIN	D25042	F1+ (mex)	169,263,678	1.88%
FSP	NAFIN	D25043	F1+ (mex)	314,970,875	3.51%
Chequera Dolares				5,667,226,050	63.06%
CHD	37-006	4006562	N/A	2,092,704,216	23.29%
CHD	37-135	6009236	N/A	2,252,020,738	25.06%
CHD	40-002	9409199	N/A	282,935	0.00%
CHD	40-012	6539459	N/A	198,907,253	2.21%
CHD	40-044	0941285	N/A	1,123,310,910	12.50%
TOTAL CARTERA				8,986,517,560	100.00%
ACTIVO NETO				6,216,746,829	
Cartera al:		26/06/2025			

Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio:
1.1270%

Parametros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana. *De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV