

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AAA/4CP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			1,459,271,621	55.02%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	220,240,697	8.30%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	194,429,156	7.33%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	190,928,494	7.20%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	171,167,008	6.45%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	143,133,809	5.40%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	116,131,349	4.38%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	112,303,547	4.23%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	90,154,933	3.40%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	86,511,915	3.26%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	85,091,017	3.21%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	49,179,697	1.85%
	Certificados Bursátiles Corporativos			341,888,113	12.89%
91	LALA	18	AA (mex)	93,452,286	3.52%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,805,670	3.12%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	49,234,551	1.86%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,353,634	1.71%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	38,950,938	1.47%
91	BRX	22	AA (mex)	20,591,408	0.78%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,499,626	0.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			470,741,548	17.75%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	470,741,548	17.75%
	Chequera Dolares			190,844	0.01%
CHD	40-133	8034712		190,844	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			41,454,729	1.56%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,454,729	1.56%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			77,940,846	2.94%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	77,940,846	2.94%

	Reportos			260,866,821	9.84%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	260,866,821	9.84%
	TOTAL CARTERA			2,652,354,522	100.00%
	ACTIVO NETO			2,674,559,815	

Cartera al: 19/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.321 %

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."