

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			565,105,029	26.98%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	226,434,281	10.81%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	199,222,118	9.51%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	114,249,696	5.45%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	25,198,935	1.20%
	Certificados Bursátiles Corporativos			350,465,270	16.73%
91	LALA	18	AA (mex)	96,971,975	4.63%
91	GAP	24-2L	mxAAA	84,248,911	4.02%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	50,975,810	2.43%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,352,764	2.17%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,295,298	1.92%
91	BRX	22	AA (mex)	21,271,965	1.02%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,348,548	0.54%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			479,401,964	22.89%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	479,401,964	22.89%
	Chequera Dolares			191,006	0.01%
CHD	40-133	8034712		191,006	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,402,424	1.93%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,402,424	1.93%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			79,809,342	3.81%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	79,809,342	3.81%
	Reportos			579,325,750	27.66%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	254,504,516	12.15%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	227,251,322	10.85%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	97,569,911	4.66%
	TOTAL CARTERA			2,094,700,785	100.00%
	ACTIVO NETO			2,080,942,934	

Cartera al:

20/02/2025

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.100 %

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."