

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			402,054,801	23.34%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	198,518,372	11.52%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	101,906,271	5.91%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	101,630,158	5.90%
	Certificados Bursátiles Corporativos			330,318,526	19.17%
91	LALA	18	AA (mex)	96,419,074	5.60%
91	GAP	24-2L	mxAAA	83,762,467	4.86%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	50,815,160	2.95%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,245,363	2.63%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	42,440,463	2.46%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,636,000	0.68%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			289,861,380	16.82%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	289,861,380	16.82%
	Chequera Dolares			183,457	0.01%
CHD	40-133	8034712		183,457	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			42,381,120	2.46%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	42,381,120	2.46%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			79,115,696	4.59%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	79,115,696	4.59%
	Reportos			579,083,895	33.61%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	308,042,715	17.88%
IS	BPA182	320324	AAA(mex)	271,041,181	15.73%
	TOTAL CARTERA			1,722,998,875	100.00%
	ACTIVO NETO			1,724,906,654	

Cartera al:

15/05/2025

Límite Máximo de VaR:

0.830 % Var Promedio: 0.136 %

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."
