

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				300,223,785	12.49%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	198,518,154	8.26%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	101,705,631	4.23%
Certificados Bursátiles Corporativos				326,832,078	13.60%
91	LALA	18	AA (mex)	97,300,793	4.05%
91	GAP	24-2L	mxAAA	89,215,079	3.71%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	52,594,774	2.19%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,192,904	1.88%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	42,528,527	1.77%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,262,210,348	52.52%
BI	CETES	260528	AAA(mex)	333,587,098	13.88%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	297,879,870	12.40%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	293,599,620	12.22%
BI	CETES	251211	AAA(mex)	196,279,940	8.17%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	94,263,760	3.92%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	46,600,060	1.94%
Chequera Dolares				173,919	0.01%
CHD	40-133	8034712		173,919	0.01%
Titulos de Credito Extranjeros				42,361,314	1.76%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	42,361,314	1.76%
Udibonos				50,686,856	2.11%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	50,686,856	2.11%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				82,645,096	3.44%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	82,645,096	3.44%
Reportos				338,189,490	14.07%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	335,479,011	13.96%
LF	BONDESF	270520	AAA(mex)	2,710,479	0.11%

TOTAL CARTERA	2,403,322,886	100.00%
ACTIVO NETO	2,438,242,249	

Cartera al: 11/09/2025

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.071 %

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."