

MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Trimestral De Ir			51,736,390	1.25%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,736,390	1.25%
	Certificado Bursatiles de Corto Plazo Gubernamental			9,947,377	0.24%
92	CFE	00325	AAA(mex)	9,947,377	0.24%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			821,411,830	19.78%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	336,071,400	8.09%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	185,512,000	4.47%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	177,546,260	4.28%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,341,320	1.19%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	49,154,830	1.18%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,786,020	0.57%
	Chequera Dolares			132,982	0.00%
CHD	40-133	8031130		132,982	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			359,033,683	8.65%
93	START	05024	HR+1	59,524,768	1.43%
93	START	04824	HR+1	49,072,568	1.18%
93	START	04924	HR+1	30,008,118	0.72%
93	START	04124	HR+1	26,162,243	0.63%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,539,339	0.62%
93	START	00225	HR+1	21,706,140	0.52%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,845,679	0.48%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,526,745	0.47%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	19,286,935	0.46%
93	START	02824	HR+1	17,747,722	0.43%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,284,416	0.42%
93	GMFIN	08424	F1+ (mex)	11,140,632	0.27%
93	START	03324	HR+1	10,063,948	0.24%
93	START	04324	HR+1	10,042,904	0.24%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,863,477	0.24%
93	START	04724	HR+1	5,021,245	0.12%

93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,820,135	0.12%
93	GMFIN	00325	F1+ (mex)	2,376,669	0.06%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				293,611,898	7.07%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	103,024,240	2.48%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	86,649,756	2.09%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	52,751,533	1.27%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	51,186,369	1.23%
Reportos				1,108,342,179	26.69%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	781,434,334	18.82%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	326,907,844	7.87%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				1,508,688,162	36.33%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	500,341,460	12.05%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	199,142,406	4.80%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,668,851	2.64%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	100,258,337	2.41%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	100,163,986	2.41%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	100,037,541	2.41%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	99,936,255	2.41%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,781,936	2.40%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	99,759,874	2.40%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	49,885,937	1.20%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,711,580	1.20%
TOTAL CARTERA				4,152,904,501	100.00%
ACTIVO NETO				4,157,049,533	

Cartera al: 16/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.014 %
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."