

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			300,259,812	19.81%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	128,826,838	8.50%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	75,482,125	4.98%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	48,501,880	3.20%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,766,256	2.16%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,682,713	0.97%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			39,624,744	2.61%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	25,785,685	1.70%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,839,059	0.91%
	Certificados Bursátiles Corporativos			472,266,342	31.16%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	42,243,383	2.79%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,934,407	1.84%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,799,716	1.70%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	24,588,045	1.62%
91	OSM	15U	mxAA-	23,349,185	1.54%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,779,046	1.44%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,776,796	1.44%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,236,575	1.40%
91	MEDICA	20	AA (mex)	20,181,182	1.33%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,339,601	1.28%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,007,174	1.25%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,218,959	1.20%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,068,854	1.19%
91	SALUD	21	HR A	18,013,578	1.19%
91	SALUD	20	HR A	16,581,033	1.09%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,886,112	1.05%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,385,797	1.02%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	13,988,442	0.92%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,959,982	0.86%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,852,911	0.78%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,155,877	0.60%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,424,122	0.49%

91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,015,518	0.46%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,370,142	0.42%
91	GHEMA	23	HR BBB+	6,040,200	0.40%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,354,180	0.35%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	5,030,192	0.33%
91	NM	15	mxAA+	4,087,193	0.27%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,970,931	0.20%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,530,829	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,834,236	0.12%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	1,679,045	0.11%
91	GHO�B	14	HR D	1,369,480	0.09%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,310,978	0.09%
91	OSM	15	mxAA-	760,991	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	625,612	0.04%
91	DMXI	15	mxD	514,101	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,938	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			93,158,772	6.15%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,086,555	2.91%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	34,007,986	2.24%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	15,064,231	0.99%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			13,884,542	0.92%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	13,884,542	0.92%
	Udibonos			487,951,153	32.19%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	297,796,161	19.65%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	190,154,991	12.55%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			62,256,508	4.11%
95	FEFA	24B	mxAAA	21,967,775	1.45%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,540,389	0.76%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,180,697	0.67%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,067,029	0.47%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,104,375	0.40%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,932,511	0.26%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,463,734	0.10%
	Reportos			46,374,177	3.06%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	46,374,177	3.06%
	TOTAL CARTERA			1,515,776,050	100.00%
	ACTIVO NETO			1,515,194,126	

Cartera al: 19/12/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.599 %

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."
