

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			294,447,623	19.38%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	160,219,698	10.54%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	50,480,199	3.32%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	34,885,534	2.30%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	33,766,573	2.22%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	15,095,619	0.99%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			41,341,626	2.72%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,962,790	1.77%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,378,836	0.95%
	Certificados Bursátiles Corporativos			456,318,982	30.03%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	43,629,640	2.87%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,067,887	1.85%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	26,529,347	1.75%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	26,277,281	1.73%
91	OSM	15U	mxAA-	23,417,928	1.54%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,452,727	1.48%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	22,331,326	1.47%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,705,346	1.43%
91	MEDICA	20	AA (mex)	20,661,536	1.36%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,070,427	1.32%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	19,101,285	1.26%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,876,208	1.24%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,834,056	1.24%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,460,062	1.08%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,929,941	1.05%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,551,835	0.96%
91	FIHO	19	AA- (mex)	13,493,451	0.89%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,613,717	0.76%
91	GAP	22-2	mxAAA	9,139,730	0.60%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,781,807	0.58%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,338,826	0.48%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,019,407	0.46%

91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,545,095	0.43%
91	GHEMA	23	HR BBB+	5,994,994	0.39%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,260,945	0.35%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,998,573	0.33%
91	NM	15	mxAA+	4,013,198	0.26%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,931,900	0.19%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,525,438	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,887,007	0.12%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	1,734,207	0.11%
91	GHOCB	14	HR D	1,369,480	0.09%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,232,348	0.08%
91	OSM	15	mxAA-	747,564	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	612,825	0.04%
91	DMXI	15	mxD	181,641	0.01%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			60,515,377	3.98%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	45,102,725	2.97%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	15,412,652	1.01%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			28,880,966	1.90%
IISP	SHV	*		28,880,966	1.90%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			14,486,754	0.95%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,486,754	0.95%
	Udibonos			514,693,110	33.87%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	317,306,367	20.88%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	197,386,742	12.99%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			63,214,042	4.16%
95	FEFA	24B	mxAAA	22,664,289	1.49%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,620,981	0.77%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,545,789	0.69%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,061,860	0.47%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	5,999,227	0.40%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,959,692	0.26%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,362,205	0.09%
	Reportos			45,803,374	3.01%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	45,803,374	3.01%
	TOTAL CARTERA			1,519,701,854	100.00%
	ACTIVO NETO			1,519,903,061	

Cartera al: 20/02/2025

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.557 %

Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 día 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."
