

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				368,627,495	24.67%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	203,637,005	13.63%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	121,265,194	8.12%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	43,725,296	2.93%
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				42,519,001	2.85%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	27,556,724	1.85%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,962,277	1.00%
Certificados Bursátiles Corporativos				437,236,929	29.27%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	45,431,992	3.04%
91	RCO	18U	AAA (mex)	29,234,237	1.96%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	26,668,114	1.79%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	26,320,668	1.76%
91	OSM	15U	mxAA-	24,307,422	1.63%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	22,629,650	1.52%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,294,814	1.49%
91	GAP	23-2L	mxAAA	22,057,937	1.48%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	21,129,811	1.41%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	20,285,292	1.36%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,618,353	1.31%
91	AGUA	17-2X	mxA+	19,367,309	1.30%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	17,213,447	1.15%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,879,737	1.06%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,583,034	0.98%
91	FIHO	19	AA- (mex)	13,483,380	0.90%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	12,252,499	0.82%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,539,473	0.64%
91	GAP	22-2	mxAAA	9,192,566	0.62%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,568,778	0.51%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,016,562	0.47%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,790,824	0.46%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,466,863	0.37%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	5,146,892	0.35%

91	NM	15	mxAA+	4,100,797	0.27%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,530,398	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,852,202	0.12%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	1,799,640	0.12%
91	GHOCB	14	HR D	1,369,480	0.09%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,277,671	0.09%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	645,444	0.04%
91	DMXI	15	mxD	181,641	0.01%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				15,229,972	1.02%
Jl	CABEI	2-23S	mxAAA	15,229,972	1.02%
Udibonos				545,172,662	36.49%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	344,255,429	23.04%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	200,917,232	13.45%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				42,869,365	2.87%
95	FEFA	24B	mxAAA	23,821,894	1.60%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,574,369	0.71%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,272,526	0.49%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,200,576	0.08%
Reportos				42,339,072	2.83%
BI	CETES	270318	AAA(mex)	42,339,072	2.83%
TOTAL CARTERA				1,493,994,496	100.00%
ACTIVO NETO				1,496,775,093	

Cartera al: 15/05/2025

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.637 %

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."