

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				681,633,664	36.43%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	244,439,575	13.06%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	193,586,484	10.35%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	131,339,954	7.02%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	74,365,328	3.97%
M	BONOS	360221	AAA(mex)	37,902,323	2.03%
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				44,405,738	2.37%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	28,805,124	1.54%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	15,600,614	0.83%
Certificados Bursátiles Corporativos				454,510,335	24.29%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	47,263,332	2.53%
91	RCO	18U	AAA (mex)	30,106,739	1.61%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	28,820,409	1.54%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	27,432,771	1.47%
91	OSM	15U	mxAA+	25,741,610	1.38%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	23,621,867	1.26%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	23,417,148	1.25%
91	GAP	23-2L	mxAAA	22,271,713	1.19%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	21,529,047	1.15%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	20,589,009	1.10%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	20,222,461	1.08%
91	AGUA	17-2X	mxA+	19,518,137	1.04%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	17,450,160	0.93%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	16,414,722	0.88%
91	NM	25-2	mxAA+	15,722,812	0.84%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,604,365	0.78%
91	FIHO	19	AA- (mex)	13,394,758	0.72%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	12,550,768	0.67%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,690,761	0.52%
91	GAP	22-2	mxAAA	9,371,171	0.50%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,580,860	0.41%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,020,092	0.38%

91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,867,002	0.37%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,502,602	0.29%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,514,037	0.13%
91	ALSEA	19-2	HR A+	1,931,225	0.10%
91	GHOCB	14	HR D	1,369,480	0.07%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,234,444	0.07%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	662,596	0.04%
91	DMXI	15	mxD	94,238	0.01%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				15,676,271	0.84%
Jl	CABEI	2-23S	mxAAA	15,676,271	0.84%
Udibonos				532,242,958	28.44%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	326,378,588	17.44%
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	110,410,729	5.90%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	95,453,641	5.10%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				42,317,012	2.26%
95	FEFA	24B	mxAAA	24,126,566	1.29%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,738,100	0.57%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,452,345	0.40%
Reportos				100,387,310	5.37%
LF	BONDESF	310320	AAA(mex)	100,387,310	5.37%
TOTAL CARTERA				1,871,173,288	100.00%
ACTIVO NETO				1,871,448,382	

Cartera al: 02/10/2025

Límite Máximo de VaR: 1.200 % **Var Promedio:** 0.583 %

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."