

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			1,459,652,970	54.24%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	220,625,341	8.20%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	194,883,566	7.24%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	191,254,406	7.11%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	171,189,239	6.36%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	143,169,830	5.32%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	115,786,292	4.30%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	112,698,317	4.19%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	89,856,146	3.34%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	85,851,858	3.19%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	85,347,136	3.17%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	48,990,841	1.82%
	Certificados Bursátiles Corporativos			341,738,003	12.70%
91	LALA	18	AA (mex)	93,638,472	3.48%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,600,966	3.07%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	49,290,455	1.83%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,032,567	1.67%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	38,985,227	1.45%
91	BRX	22	AA (mex)	20,651,575	0.77%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,538,741	0.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			472,429,230	17.55%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	472,429,230	17.55%
	Chequera Dolares			196,347	0.01%
CHD	40-133	8034712		196,347	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			41,477,037	1.54%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,477,037	1.54%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			78,127,060	2.90%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	78,127,060	2.90%

	Reportos			297,594,749	11.06%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	292,858,073	10.88%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	4,736,676	0.18%
	TOTAL CARTERA			2,691,215,396	100.00%
	ACTIVO NETO			2,692,172,202	

Cartera al: 31/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.317 %
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."