

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			299,595,407	19.89%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	128,210,825	8.51%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	75,257,847	5.00%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	48,647,868	3.23%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,770,511	2.18%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,708,356	0.98%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			40,117,157	2.66%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,140,589	1.74%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,976,568	0.93%
	Certificados Bursátiles Corporativos			437,873,535	29.06%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	42,503,476	2.82%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,245,939	1.88%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,951,534	1.72%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	24,517,303	1.63%
91	OSM	15U	mxAA-	23,488,237	1.56%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,962,901	1.46%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,822,896	1.45%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,223,848	1.41%
91	MEDICA	20	AA (mex)	20,257,853	1.35%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,366,485	1.29%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,123,372	1.27%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,259,077	1.21%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,082,364	1.20%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,917,413	1.06%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,403,267	1.02%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,040,087	0.93%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,984,482	0.86%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,212,170	0.74%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,145,763	0.61%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,146,909	0.47%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,044,547	0.47%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,406,463	0.43%

91	GHEMA	23	HR BBB+	6,006,729	0.40%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,129,259	0.34%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,912,669	0.33%
91	NM	15	mxAA+	4,101,560	0.27%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,981,037	0.20%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,533,733	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,839,408	0.12%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	1,686,003	0.11%
91	GHOCSB	14	HR D	1,369,480	0.09%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,317,786	0.09%
91	OSM	15	mxAA-	763,600	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	597,793	0.04%
91	DMXI	15	mxD	526,148	0.04%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,946	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			93,270,598	6.19%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,141,880	2.93%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	34,055,087	2.26%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	15,073,631	1.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			13,929,544	0.93%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	13,929,544	0.93%
	Udibonos			498,425,318	33.08%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	306,383,841	20.34%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	192,041,477	12.75%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			62,014,457	4.12%
95	FEFA	24B	mxAAA	21,923,291	1.46%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,465,203	0.76%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,152,833	0.67%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,112,624	0.47%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,034,835	0.40%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,915,058	0.26%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,410,613	0.09%
	Reportos			61,427,314	4.08%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	61,427,314	4.08%
	TOTAL CARTERA			1,506,653,330	100.00%
	ACTIVO NETO			1,506,790,872	

Cartera al: 31/12/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.602 %

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."