

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Mensual De Inte			100,366,118	1.46%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	100,366,118	1.46%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,421,806,860	20.62%
BI	CETES	260108	AAA(mex)	229,441,375	3.33%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	223,643,000	3.24%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	191,657,146	2.78%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	169,593,140	2.46%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	159,868,763	2.32%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	144,522,405	2.10%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	99,179,290	1.44%
BI	CETES	251016	AAA(mex)	93,686,950	1.36%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	86,297,466	1.25%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,917,325	0.35%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			562,666,278	8.16%
93	START	04924	HR+1	80,498,533	1.17%
93	START	00125	HR+1	64,816,168	0.94%
93	START	05024	HR+1	60,326,915	0.88%
93	START	00325	HR+1	54,106,564	0.79%
93	START	04824	HR+1	49,363,701	0.72%
93	START	03624	HR+1	35,925,169	0.52%
93	START	00525	HR+1	35,641,328	0.52%
93	START	04424	HR+1	31,515,744	0.46%
93	START	04724	HR+1	29,709,866	0.43%
93	START	00225	HR+1	28,207,887	0.41%
93	START	04524	HR+1	22,842,686	0.33%
93	START	04324	HR+1	20,028,769	0.29%
93	START	00425	HR+1	19,615,327	0.28%
93	START	00625	HR+1	18,025,654	0.26%
93	START	03324	HR+1	12,041,968	0.18%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			788,897,887	11.44%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	212,261,085	3.08%

I	BANREG	25344	F1+ (mex)	207,320,966	3.01%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	206,125,530	2.99%
I	BANREG	25181	F1+ (mex)	163,190,306	2.37%
	Reportos			1,861,900,841	27.00%
IQ	BPAG91	290913	AAA(mex)	665,044,680	9.64%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	646,008,001	9.37%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	550,848,160	7.99%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			2,160,760,484	31.33%
LF	BONDESF	251218	AAA(mex)	602,739,786	8.74%
LF	BONDESF	251016	AAA(mex)	553,645,802	8.03%
LF	BONDESF	250703	AAA(mex)	301,483,104	4.37%
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	301,091,349	4.37%
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	201,422,632	2.92%
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	100,481,313	1.46%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	99,896,498	1.45%
	TOTAL CARTERA			6,896,398,468	100.00%
	ACTIVO NETO			6,891,382,638	

Cartera al: 31/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.070 % Var Promedio: 0.012 %
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."