

MEDIANO 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 Trimestral De Ir			51,996,396	1.17%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,996,396	1.17%
	Certificado Bursatiles de Corto Plazo Gubernamental			9,995,689	0.23%
92	CFE	00325	AAA(mex)	9,995,689	0.23%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			969,416,510	21.81%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	339,186,280	7.63%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	186,714,500	4.20%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	178,914,400	4.03%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	141,687,825	3.19%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,589,645	1.12%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	49,406,535	1.11%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	23,917,325	0.54%
	Chequera Dolares			132,148	0.00%
CHD	40-133	8031130		132,148	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			382,441,222	8.61%
93	START	05024	HR+1	59,832,737	1.35%
93	START	04824	HR+1	49,324,109	1.11%
93	START	00325	HR+1	42,532,963	0.96%
93	START	04924	HR+1	30,161,878	0.68%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,675,719	0.58%
93	START	00225	HR+1	21,817,693	0.49%
93	VWLEASE	07824	mxA-1+	19,949,050	0.45%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,632,534	0.44%
93	START	00425	HR+1	19,615,427	0.44%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	19,397,150	0.44%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,377,778	0.39%
93	START	00625	HR+1	14,915,828	0.34%
93	START	03324	HR+1	10,034,974	0.23%
93	START	04324	HR+1	10,014,384	0.23%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,915,657	0.22%

93	START	04724	HR+1	5,007,123	0.11%
93	GMFIN	09024	F1+ (mex)	4,845,098	0.11%
93	GMFIN	00325	F1+ (mex)	2,391,120	0.05%
	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			295,358,373	6.65%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	103,660,483	2.33%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	87,101,237	1.96%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	53,065,271	1.19%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	51,531,382	1.16%
	Reportos			1,227,298,470	27.61%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	900,119,093	20.25%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	292,337,500	6.58%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	34,841,877	0.78%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,507,970,366	33.93%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	499,091,585	11.23%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	200,190,748	4.50%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,389,466	2.46%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	100,306,499	2.26%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,995,606	2.25%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	99,896,498	2.25%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,784,971	2.25%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	99,664,130	2.24%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,518,577	2.24%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	50,160,453	1.13%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,971,834	1.12%
	TOTAL CARTERA			4,444,609,174	100.00%
	ACTIVO NETO			4,463,369,113	

Cartera al: 31/01/2025

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.016 %
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."

