

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 Intereses				51,021,770	1.11%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	51,021,770	1.11%
Certificado Bursátiles de Corto Plazo Gubernamental				10,090,914	0.22%
92	CFE	00325	AAA(mex)	10,090,914	0.22%
Certificados De La Tesorería De La Federación				981,108,923	21.33%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	343,948,960	7.48%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	188,518,540	4.10%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	181,171,200	3.94%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	143,612,581	3.12%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,960,380	1.09%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	49,777,440	1.08%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	24,119,823	0.52%
Chequera Dolares				131,451	0.00%
CHD	40-133	8031130		131,451	0.00%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				382,223,974	8.31%
93	START	05024	HR+1	59,802,041	1.30%
93	START	04824	HR+1	49,313,363	1.07%
93	START	00325	HR+1	42,514,606	0.92%
93	START	04924	HR+1	30,146,486	0.66%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,882,335	0.56%
93	START	00225	HR+1	21,804,140	0.47%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,795,224	0.43%
93	START	00425	HR+1	19,606,744	0.43%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	19,566,031	0.43%
93	VWLEASE	01525	mxA-1+	19,131,272	0.42%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,519,690	0.38%
93	START	00625	HR+1	14,910,705	0.32%
93	START	00925	HR+1	10,029,795	0.22%
93	START	04324	HR+1	10,010,884	0.22%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,991,995	0.22%
93	START	01025	HR+1	5,005,351	0.11%
93	GMFIN	01425	F1+ (mex)	4,780,417	0.10%
93	GMFIN	00325	F1+ (mex)	2,412,896	0.05%

	Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)			297,959,718	6.48%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	104,613,590	2.27%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	87,764,507	1.91%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	53,539,797	1.16%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	52,041,823	1.13%
	Reportos			1,220,558,437	26.53%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	893,483,103	19.42%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	163,721,548	3.56%
BI	CETES	260205	AAA(mex)	146,028,135	3.17%
BI	CETES	250626	AAA(mex)	17,325,651	0.38%
	Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal			1,657,303,785	36.03%
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	499,031,600	10.85%
LF	BONDESF	270923	AAA(mex)	200,167,940	4.35%
LF	BONDESF	280224	AAA(mex)	149,467,551	3.25%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	109,385,935	2.38%
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	100,283,949	2.18%
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	99,979,663	2.17%
LF	BONDESF	261008	AAA(mex)	99,886,802	2.17%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	99,781,601	2.17%
LF	BONDESF	271202	AAA(mex)	99,675,987	2.17%
LF	BONDESF	281228	AAA(mex)	99,521,150	2.16%
LF	BONDESF	270722	AAA(mex)	50,147,208	1.09%
LF	BONDESF	290719	AAA(mex)	49,974,400	1.09%
	TOTAL CARTERA			4,600,398,972	100.00%
	ACTIVO NETO			4,957,303,176	
	Cartera al:	28/02/2025			

Límite Máximo de VaR:

0.250 % Var Promedio: 0.019 %

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."