

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			1,456,792,503	54.23%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	220,274,609	8.20%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	194,401,058	7.24%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	190,824,600	7.10%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	170,682,255	6.35%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	142,732,088	5.31%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	115,974,249	4.32%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	112,515,943	4.19%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	89,709,598	3.34%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	85,899,232	3.20%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	84,904,035	3.16%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	48,874,837	1.82%
	Certificados Bursátiles Corporativos			341,422,109	12.71%
91	LALA	18	AA (mex)	93,388,774	3.48%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,457,762	3.07%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	49,144,220	1.83%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,472,449	1.69%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	38,861,779	1.45%
91	BRX	22	AA (mex)	20,584,253	0.77%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,512,872	0.43%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			471,673,512	17.56%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	471,673,512	17.56%
	Chequera Dolares			190,001	0.01%
CHD	40-133	8034712		190,001	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			41,367,074	1.54%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,367,074	1.54%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			78,038,513	2.91%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	78,038,513	2.91%

	Reportos			296,915,973	11.05%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	296,915,973	11.05%
	TOTAL CARTERA			2,686,399,685	100.00%
	ACTIVO NETO			2,687,094,788	

Cartera al: 26/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.319 %

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."