

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			50,877,511	1.11%
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	50,877,511	1.11%
	Certificado Bursatiles de Corto Plazo Gubernamental			10,071,665	0.22%
92	CFE	00325	AAA(mex)	10,071,665	0.22%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			976,466,014	21.33%
BI	CETES	261126	AAA(mex)	341,872,800	7.47%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	187,944,160	4.11%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	180,410,900	3.94%
BI	CETES	270121	AAA(mex)	142,706,004	3.12%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	49,829,935	1.09%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	49,648,100	1.09%
BI	CETES	250724	AAA(mex)	24,054,115	0.53%
	Chequera Dolares			129,753	0.00%
CHD	40-133	8031130		129,753	0.00%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			381,399,816	8.33%
93	START	05024	HR+1	59,638,869	1.30%
93	START	04824	HR+1	49,180,261	1.07%
93	START	00325	HR+1	42,400,853	0.93%
93	START	04924	HR+1	30,065,060	0.66%
93	VWLEASE	09324	mxA-1+	25,811,859	0.56%
93	START	00225	HR+1	21,745,250	0.48%
93	GMFIN	11424	F1+ (mex)	19,739,988	0.43%
93	START	00425	HR+1	19,553,789	0.43%
93	GMFIN	13224	F1+ (mex)	19,511,913	0.43%
93	VWLEASE	01525	mxA-1+	19,056,285	0.42%
93	GMFIN	11124	F1+ (mex)	17,471,038	0.38%
93	START	00625	HR+1	14,985,262	0.33%
93	START	04324	HR+1	10,064,238	0.22%
93	START	00925	HR+1	10,002,705	0.22%
93	GMFIN	09924	F1+ (mex)	9,965,047	0.22%

93	START	04724	HR+1	5,031,814	0.11%
93	GMFIN	01425	F1+ (mex)	4,768,921	0.10%
93	GMFIN	00325	F1+ (mex)	2,406,663	0.05%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				297,093,080	6.49%
I	BANREG	25344	F1+ (mex)	104,299,241	2.28%
I	BANREG	25175	F1+ (mex)	87,554,500	1.91%
I	BANREG	25304	F1+ (mex)	53,385,012	1.17%
I	BANREG	25444	F1+ (mex)	51,854,328	1.13%
Reportos				1,199,925,040	26.21%
BI	CETES	251030	AAA(mex)	873,021,793	19.07%
LD	BONDES	251211	AAA(mex)	326,903,247	7.14%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				1,661,446,289	36.30%
LF	BONDES	270225	AAA(mex)	501,425,510	10.95%
LF	BONDES	270923	AAA(mex)	199,604,060	4.36%
LF	BONDES	280224	AAA(mex)	150,174,443	3.28%
LF	BONDES	290419	AAA(mex)	109,907,593	2.40%
LF	BONDES	261008	AAA(mex)	100,356,130	2.19%
LF	BONDES	270422	AAA(mex)	100,260,018	2.19%
LF	BONDES	271202	AAA(mex)	100,145,565	2.19%
LF	BONDES	270819	AAA(mex)	100,015,267	2.19%
LF	BONDES	281228	AAA(mex)	100,002,610	2.19%
LF	BONDES	270318	AAA(mex)	99,712,025	2.18%
LF	BONDES	270722	AAA(mex)	50,012,852	1.09%
LF	BONDES	290719	AAA(mex)	49,830,217	1.09%
TOTAL CARTERA				4,577,409,168	100.00%
ACTIVO NETO				4,756,747,702	

Cartera al: 20/02/2025

Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.020 %
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."