

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			299,210,741	19.92%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	128,076,992	8.53%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	75,380,015	5.02%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	48,395,300	3.22%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,673,460	2.18%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,684,974	0.98%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			39,787,748	2.65%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	25,910,417	1.73%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	13,877,332	0.92%
	Certificados Bursátiles Corporativos			472,133,131	31.44%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	42,311,398	2.82%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,032,163	1.87%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,843,139	1.72%
91	XIGNUX	24-2	Aaa.mx	24,455,759	1.63%
91	OSM	15U	mxAA-	23,381,556	1.56%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,854,011	1.46%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	21,756,632	1.45%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,170,545	1.41%
91	MEDICA	20	AA (mex)	20,213,731	1.35%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	19,290,546	1.28%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,039,183	1.27%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,213,960	1.21%
91	SALUD	21	HR A	18,058,909	1.20%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,020,220	1.20%
91	SALUD	20	HR A	16,623,994	1.11%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	15,867,955	1.06%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,357,569	1.02%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	13,970,617	0.93%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,947,413	0.86%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,817,918	0.79%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,122,820	0.61%
91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,428,722	0.50%

91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,031,479	0.47%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,379,777	0.43%
91	GHEMA	23	HR BBB+	5,993,563	0.40%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,351,051	0.36%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,895,657	0.33%
91	NM	15	mxAA+	4,094,923	0.27%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,974,353	0.20%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,525,593	0.17%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,834,149	0.12%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	1,678,900	0.11%
91	GHO�B	14	HR D	1,369,480	0.09%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,314,577	0.09%
91	OSM	15	mxAA-	761,881	0.05%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	626,459	0.04%
91	DMXI	15	mxD	520,588	0.04%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,942	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			93,155,963	6.20%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	44,090,100	2.94%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	34,003,160	2.26%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	15,062,703	1.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			13,858,580	0.92%
J1	CABEI	2-23S	mxAAA	13,858,580	0.92%
	Udibonos			496,592,316	33.06%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	305,621,396	20.35%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	190,970,921	12.72%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			62,159,794	4.14%
95	FEFA	24B	mxAAA	21,876,561	1.46%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,540,440	0.77%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,135,286	0.68%
95	PEMEX	14U	mxAAA	7,084,486	0.47%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,118,933	0.41%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	3,937,751	0.26%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,466,337	0.10%
	Reportos			25,055,594	1.67%
LF	BONDESF	321021	AAA(mex)	25,055,594	1.67%
	TOTAL CARTERA			1,501,953,867	100.00%
	ACTIVO NETO			1,501,545,136	

Cartera al: 26/12/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.602 %

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."
