

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			541,940,193	25.89%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	227,413,080	10.86%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	199,984,534	9.55%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	114,542,579	5.47%
	Certificados Bursátiles Corporativos			352,920,462	16.86%
91	LALA	18	AA (mex)	97,639,693	4.67%
91	GAP	24-2L	mxAAA	85,172,815	4.07%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	51,394,324	2.46%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,047,197	2.15%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,896,655	1.95%
91	BRX	22	AA (mex)	21,383,071	1.02%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,386,708	0.54%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			480,632,079	22.96%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	480,632,079	22.96%
	Chequera Dolares			193,506	0.01%
CHD	40-133	8034712		193,506	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,928,870	1.96%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,928,870	1.96%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			80,188,112	3.83%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	80,188,112	3.83%
	Reportos			596,414,275	28.49%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	289,497,720	13.83%
LF	BONDES F	280127	AAA(mex)	287,770,052	13.75%
LF	BONDES F	260604	AAA(mex)	19,146,503	0.92%
	TOTAL CARTERA			2,093,217,497	100.00%
	ACTIVO NETO			2,093,304,819	

Cartera al:

28/02/2025

Límite Máximo de VaR:

0.830 % Var Promedio: 0.096 %

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."
