

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.					AA/2LP
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>303,034,207</b>	<b>3.46%</b>
M	BONOS	260903	AAA(mex)	239,883,778	2.74%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	63,150,429	0.72%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>600,552,156</b>	<b>6.85%</b>
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	600,552,156	6.85%
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>69,528,178</b>	<b>0.79%</b>
94	COMPART	20	AA (mex)	69,528,178	0.79%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>2,569,827,053</b>	<b>29.30%</b>
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	195,332,474	2.23%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	192,638,943	2.20%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	185,454,651	2.11%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	180,919,832	2.06%
91	AERMXCB	19	AA+/M	175,428,824	2.00%
91	GICSA	19	B/M	171,713,817	1.96%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	170,649,132	1.95%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	165,514,941	1.89%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,080,270	1.63%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	120,936,310	1.38%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	101,263,374	1.15%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	99,151,966	1.13%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	92,299,821	1.05%
91	CADU	20V	A/M	73,502,379	0.84%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	71,300,519	0.81%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	67,011,898	0.76%
91	TPLAYCB	20	HR AA	64,946,212	0.74%
91	IDEI	23+V	HR BBB	48,237,983	0.55%
91	GHEMA	23	HR BBB+	43,160,772	0.49%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	42,648,333	0.49%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	37,326,836	0.43%
91	GICSA	17	B/M	23,639,587	0.27%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,832,963	0.25%

91	HERDEZ	17	AA (mex)	20,207,058	0.23%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,022,687	0.23%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	17,649,135	0.20%
91	AMX	22	AAA (mex)	11,886,454	0.14%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,889,003	0.11%
91	GICSA	15	B/M	2,180,880	0.03%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>920,053,658</b>	<b>10.49%</b>
BI	CETES	260806	AAA(mex)	503,279,460	5.74%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	274,016,730	3.12%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	132,795,675	1.51%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,961,793	0.11%
	<b>Chequera Euros</b>			<b>91,194</b>	<b>0.00%</b>
CHE	40-012	5514622		91,194	0.00%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>116,471,346</b>	<b>1.33%</b>
CHD	40-110	8377998		115,778,799	1.32%
CHD	40-133	8030298		692,547	0.01%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>191,849,801</b>	<b>2.19%</b>
JE	AMX	0624	AAA (mex)	191,849,801	2.19%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas</b>			<b>431,771,657</b>	<b>4.92%</b>
D2	CAF872	310222	AA-	431,771,657	4.92%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come</b>			<b>90,707,503</b>	<b>1.03%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	90,707,503	1.03%
	<b>Swaps Entregables</b>			<b>-39,262,295</b>	<b>-0.45%</b>
SWP	1USDSUS	290723		-7,336,620	-0.08%
SWP	1USDSUS	260805		-9,633,383	-0.11%
SWP	1MXPTIE	290806		-4,232,700	-0.05%
SWP	1MXPTIE	340804		-10,701,500	-0.12%
SWP	1MXPTIE	340804		-3,783,000	-0.04%
SWP	1MXPTIE	340804		-3,681,900	-0.04%
SWP	1USDSUS	260917		-22,542	0.00%
SWP	2TIEMXP	241111		129,350	0.00%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>95,548,207</b>	<b>1.09%</b>
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,548,207	1.09%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede</b>			<b>1,482,974,028</b>	<b>16.91%</b>
95	PEMEX	19	mxAAA	666,348,461	7.60%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	498,810,649	5.69%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	317,814,919	3.62%

	<b>Reportos</b>			<b>1,938,383,597</b>	<b>22.10%</b>
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	1,205,164,549	13.74%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	450,134,550	5.13%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	283,084,499	3.23%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>8,771,530,290</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>8,841,936,653</b>	

Cartera al: 19/09/2024

**Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.067 %**

**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."