

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			1,464,800,158	56.06%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	220,235,461	8.43%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	194,118,960	7.43%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	190,691,560	7.30%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	171,111,749	6.55%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	143,278,947	5.48%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	119,074,539	4.56%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	111,848,016	4.28%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	90,261,828	3.45%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	88,178,907	3.38%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	86,090,553	3.30%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	49,909,639	1.91%
	Certificados Bursátiles Corporativos			343,849,876	13.16%
91	LALA	18	AA (mex)	93,317,313	3.57%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,847,141	3.17%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	49,182,548	1.88%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,118,010	1.73%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,369,755	1.58%
91	BRX	22	AA (mex)	20,551,725	0.79%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,463,385	0.44%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			468,797,813	17.94%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	468,797,813	17.94%
	Chequera Dolares			189,952	0.01%
CHD	40-133	8034712		189,952	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,940,300	1.57%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,940,300	1.57%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			77,815,357	2.98%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	77,815,357	2.98%

	Reportos			216,534,535	8.29%
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	216,534,535	8.29%
	TOTAL CARTERA			2,612,927,991	100.00%
	ACTIVO NETO			2,613,823,712	

Cartera al: 05/12/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.324 %

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."