

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			789,784,371	33.55%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	539,333,979	22.91%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	110,009,020	4.67%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	94,803,320	4.03%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	45,638,052	1.94%
	Certificados Bursátiles Corporativos			246,852,488	10.49%
91	LALA	18	AA (mex)	92,444,629	3.93%
91	GAP	24-2L	mxAAA	83,380,916	3.54%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	39,324,388	1.67%
91	BRX	22	AAA (mex)	20,423,914	0.87%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,278,641	0.48%
	Chequera Dolares			206	0.00%
CHD	40-133	8034712		206	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,315,704	1.71%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,315,704	1.71%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			20,111,468	0.85%
93	TPLAY	00223	HR2	20,111,468	0.85%
	Udibonos			15,835,977	0.67%
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	15,835,977	0.67%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			230,548,030	9.80%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	152,735,217	6.49%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	77,812,813	3.31%
	Reportos			1,010,339,557	42.92%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	1,010,339,557	42.92%
	TOTAL CARTERA			2,353,787,801	100.00%
	ACTIVO NETO			2,353,248,956	

Cartera al:

18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.129 %

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."