

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/4CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>204,427,276</b>	<b>8.51%</b>
M	BONOS	250306	AAA(mex)	109,462,585	4.56%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	94,964,691	3.95%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>250,881,332</b>	<b>10.44%</b>
91	LALA	18	AA (mex)	92,729,888	3.86%
91	GAP	24-2L	mxAAA	84,107,977	3.50%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,586,596	1.73%
91	BRX	22	AAA (mex)	21,264,206	0.89%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,192,664	0.47%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>38,604,007</b>	<b>1.61%</b>
CHD	40-110	1966526		38,603,786	1.61%
CHD	40-133	8034712		221	0.00%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>41,302,934</b>	<b>1.72%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,302,934	1.72%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come</b>			<b>20,157,223</b>	<b>0.84%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	20,157,223	0.84%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede</b>			<b>80,986,091</b>	<b>3.37%</b>
95	CFE	20-2	AAA (mex)	80,986,091	3.37%
	<b>Reportos</b>			<b>1,766,929,361</b>	<b>73.52%</b>
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	1,235,427,723	51.41%
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	267,484,185	11.13%
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	264,017,453	10.99%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,403,288,224</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,402,660,054</b>	

Cartera al: 19/09/2024

---

**Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.070 %**

**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."**

---