

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			204,427,276	8.51%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	109,462,585	4.56%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	94,964,691	3.95%
	Certificados Bursátiles Corporativos			250,881,332	10.44%
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%
	Chequera Dolares			38,604,007	1.61%
CHD	40-110	1966526		38,603,786	1.61%
CHD	40-133	8034712		221	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			41,302,934	1.72%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,302,934	1.72%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come			20,157,223	0.84%
93	TPLAY	00223	HR2	20,157,223	0.84%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			80,986,091	3.37%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	80,986,091	3.37%
	Reportos			1,766,929,361	73.52%
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%
	TOTAL CARTERA			2,403,288,224	100.00%
	ACTIVO NETO			2,402,660,054	

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."
