

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			475,494,562	19.74%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	125,237,816	5.20%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	110,158,953	4.57%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	95,160,323	3.95%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	92,419,102	3.84%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	52,518,368	2.18%
	Certificados Bursátiles Corporativos			339,577,663	14.10%
91	LALA	18	AA (mex)	91,681,028	3.81%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,086,206	3.41%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	48,394,312	2.01%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,170,684	1.88%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,962,169	1.70%
91	BRX	22	AA (mex)	20,029,257	0.83%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,254,007	0.47%
	Chequera Dolares			95,060	0.00%
CHD	40-133	8034712		95,060	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,476,852	1.68%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,476,852	1.68%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fedc			79,762,906	3.31%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	79,762,906	3.31%
	Reportos			1,472,968,895	61.16%
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	775,484,958	32.20%
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	592,195,202	24.59%
LD	BONDESD	260212	AAA(mex)	105,288,735	4.37%
	TOTAL CARTERA			2,408,375,938	100.00%
	ACTIVO NETO			2,407,892,754	

Cartera al:

17/10/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.126 %

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."
