

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			395,828,098	23.15%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	159,929,888	9.35%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	114,350,256	6.69%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	74,244,524	4.34%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,910,404	1.93%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,393,027	0.84%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			46,600,783	2.73%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	27,277,030	1.60%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,736,890	0.86%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,586,863	0.27%
	Certificados Bursátiles Corporativos			478,519,580	27.98%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	43,704,022	2.56%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,989,209	1.70%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,682,292	1.50%
91	OSM	15U	mxAA-	23,611,155	1.38%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,694,841	1.33%
91	GAP	23-2L	mxAAA	22,513,019	1.32%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,684,770	1.27%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	21,003,907	1.23%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	20,638,023	1.21%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,590,775	1.15%
91	LAMOSAS	19	AA (mex)	19,084,031	1.12%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	19,009,990	1.11%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,859,628	1.10%
91	SALUD	21	HR A+	18,009,052	1.05%
91	SALUD	20	HR A+	16,757,198	0.98%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,553,885	0.97%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,725,289	0.92%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,482,557	0.85%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,876,482	0.75%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	12,112,591	0.71%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,055,863	0.53%

91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,250,773	0.42%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,065,067	0.41%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,544,377	0.38%
91	GHEMA	23	HR BBB+	6,023,638	0.35%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,313,729	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,872,652	0.29%
91	NM	15	mxAA+	3,980,966	0.23%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,175,227	0.19%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,891,628	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,646,319	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,876,332	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,291,042	0.08%
91	GHO�B	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	740,553	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	637,951	0.04%
91	DMXI	15	mxD	429,774	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,881	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			90,983,411	5.32%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,075,290	2.52%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	33,186,107	1.94%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	14,722,014	0.86%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			23,284,996	1.36%
1ISP	SHV	*	Alta	23,284,996	1.36%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			15,152,791	0.89%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	15,152,791	0.89%
	Udibonos			582,180,780	34.05%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	233,321,731	13.65%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	165,819,322	9.70%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	159,651,662	9.34%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	23,388,065	1.37%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			41,682,533	2.44%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	12,241,461	0.72%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,358,616	0.61%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,926,483	0.41%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,382,839	0.37%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,118,796	0.24%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,654,337	0.10%
	Reportos			35,751,386	2.09%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	35,751,386	2.09%
	TOTAL CARTERA			1,709,984,358	100.00%

ACTIVO NETO

1,715,619,074

Cartera al:

19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.611 %

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."
