

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			490,725,782	5.91%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	392,490,824	4.73%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	64,435,576	0.78%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	33,799,382	0.41%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			602,506,975	7.25%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	602,506,975	7.25%
	Certificados Bursátiles Bancarios			69,029,203	0.83%
94	COMPART	20	AA (mex)	69,029,203	0.83%
	Certificados Bursátiles Corporativos			2,563,262,451	30.86%
91	ELEKTRA	22-2	HR AA	190,991,210	2.30%
91	MOLYMET	21-2	AAA (mex)	188,350,631	2.27%
91	AERMXCB	19	HR AA+	188,043,779	2.26%
91	LAB	23-2	AA+ (mex)	186,065,503	2.24%
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	181,510,477	2.19%
91	TRAXION	20	A+ (mex)	175,175,387	2.11%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	168,833,714	2.03%
91	GICSA	19	B/M	167,395,352	2.02%
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	143,678,188	1.73%
91	AB&CCB	22-2	AAA (mex)	119,672,035	1.44%
91	FUNO	23-3L	AAA (mex)	100,835,229	1.21%
91	ZKCCB	17	A+ (mex)	95,049,010	1.14%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	90,967,668	1.10%
91	CADU	20V	A/M	71,741,310	0.86%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	70,447,836	0.85%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	65,050,108	0.78%
91	TPLAYCB	20	HR AA	64,519,598	0.78%
91	IDEI	23+V	HR BBB	48,382,590	0.58%
91	GHEMA	23	HR BBB+	43,330,217	0.52%
91	MOLYMET	23-2	AAA (mex)	41,172,782	0.50%
91	VOLARCB	21L	HR AA+	37,088,012	0.45%
91	GICSA	17	B/M	22,907,984	0.28%

91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	21,218,071	0.26%
91	BEGRAND	23	A+/M	20,097,244	0.24%
91	HERDEZ	17	AA (mex)	19,799,798	0.24%
91	GPH	19-2	AAA (mex)	17,139,104	0.21%
91	AMX	22	AAA (mex)	11,925,240	0.14%
91	VINTE	17-2	HR AA-	9,752,226	0.12%
91	GICSA	15	B/M	2,122,147	0.03%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			761,393,506	9.17%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	620,174,100	7.47%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	131,310,450	1.58%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	9,908,956	0.12%
	Chequera Euros			92,424	0.00%
CHE	40-012	5514622		92,424	0.00%
	Chequera Dolares			562,530	0.01%
CHD	40-133	8030298		562,530	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			190,799,370	2.30%
JE	AMX	0624	AAA (mex)	190,799,370	2.30%
	Eurobonos de Empresas Privadas			417,609,000	5.03%
D2	CAF872	310222	AA-	417,609,000	5.03%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			90,153,540	1.09%
93	TPLAY	00223	HR2	90,153,540	1.09%
	Swaps Entregables			8,025,585	0.10%
SWP	1USDSUS	290723		-4,845,900	-0.06%
SWP	1USDSUS	260805		-4,864,440	-0.06%
SWP	1MXPTIE	340804		5,741,325	0.07%
SWP	2TIEMXP	290713		4,016,100	0.05%
SWP	1MXPTIE	290806		3,694,200	0.04%
SWP	1MXPTIE	340804		2,119,650	0.03%
SWP	1MXPTIE	340804		2,020,350	0.02%
SWP	2TIEMXP	241111		144,300	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			95,023,741	1.14%
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	95,023,741	1.14%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			1,575,408,433	18.97%
95	PEMEX	19	mxAAA	661,424,696	7.96%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	490,505,806	5.91%
95	PEMEX	14-2	mxAAA	294,711,272	3.55%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	128,766,660	1.55%

	Reportos			1,441,913,218	17.36%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	1,408,883,109	16.96%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	33,030,109	0.40%
	TOTAL CARTERA			8,306,505,758	100.00%
	ACTIVO NETO			8,405,370,826	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 0.492 % Var Promedio: 0.098 %
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."