

DISCRECIONAL					
	HR Ratings de México, S.A. De C.V.			AAA/4CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. 1	asa Fija		747,451,390	31.59%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	541,497,801	22.89%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	110,530,419	4.67%
М	BONOS	260305	AAA(mex)	95,423,170	4.03%
	Certificados Bursátiles Corporativos			249,074,508	10.53%
91	LALA	18	AA (mex)	93,524,438	3.95%
91	GAP	24-2L	mxAAA	84,231,861	3.56%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	39,786,680	1.68%
91	BRX	22	AAA (mex)	20,591,040	0.87%
91	FUNO	15	AAA (mex)	10,940,489	0.46%
	Chequera Dolares			213	0.00%
CHD	40-133	8034712		213	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			39,449,210	1.67%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	39,449,210	1.67%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			20,006,956	0.85%
93	TPLAY	00223	HR2	20,006,956	0.85%
	Udibonos			16,207,347	0.69%
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	16,207,347	0.69%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			231,941,478	9.80%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	153,377,035	6.48%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	78,564,443	3.32%
	Reportos			1,062,014,533	44.88%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	1,062,014,533	44.88%
	TOTAL CARTERA			2,366,145,635	100.00%
	ACTIVO NETO			2,365,174,925	

Cartera al: 31/07/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.111 %
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."