

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/4CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>755,314,032</b>	<b>31.60%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	546,786,642	22.87%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	111,690,210	4.67%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	96,837,181	4.05%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>253,043,807</b>	<b>10.59%</b>
91	LALA	18	AA (mex)	94,947,870	3.97%
91	GAP	24-2L	mxAAA	85,612,495	3.58%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,415,373	1.69%
91	BRX	22	AAA (mex)	20,976,438	0.88%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,091,632	0.46%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>226</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8034712		226	0.00%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>39,965,261</b>	<b>1.67%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	39,965,261	1.67%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>20,034,120</b>	<b>0.84%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	20,034,120	0.84%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>234,601,696</b>	<b>9.81%</b>
95	PEMEX	13-2	mxAAA	154,963,966	6.48%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	79,637,730	3.33%
	<b>Reportos</b>			<b>1,087,585,889</b>	<b>45.50%</b>
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,087,585,889	45.50%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,390,545,031</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,389,546,052</b>	

**Cartera al: 30/08/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.075 %**

**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."**