

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>205,184,200</b>	<b>8.51%</b>
M	BONOS	250306	AAA(mex)	109,767,657	4.56%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	95,416,543	3.96%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>302,551,264</b>	<b>12.55%</b>
91	LALA	18	AA (mex)	92,819,020	3.85%
91	GAP	24-2L	mxAAA	83,817,685	3.48%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	51,731,248	2.15%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,547,353	1.72%
91	BRX	22	AAA (mex)	21,392,757	0.89%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,243,201	0.47%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>39,489,719</b>	<b>1.64%</b>
CHD	40-110	1966526		39,489,494	1.64%
CHD	40-133	8034712		225	0.00%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>41,044,269</b>	<b>1.70%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,044,269	1.70%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Come</b>			<b>20,049,829</b>	<b>0.83%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	20,049,829	0.83%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede</b>			<b>80,234,971</b>	<b>3.33%</b>
95	CFE	20-2	AAA (mex)	80,234,971	3.33%
	<b>Reportos</b>			<b>1,721,438,981</b>	<b>71.43%</b>
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	1,721,438,981	71.43%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,409,993,233</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,408,952,975</b>	

Cartera al: 30/09/2024

---

**Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.069 %**

**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."**

---