

### DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>396,036,315</b>	<b>23.70%</b>
M	BONOS	421113	AAA(mex)	166,583,894	9.97%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	109,822,544	6.57%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	71,449,068	4.28%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	33,462,404	2.00%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,718,406	0.88%
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>45,228,541</b>	<b>2.71%</b>
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,516,117	1.59%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,152,774	0.85%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,559,649	0.27%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>470,323,768</b>	<b>28.15%</b>
91	FIBRAHD	19U	HR AA	42,634,426	2.55%
91	RCO	18U	AAA (mex)	27,879,842	1.67%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,161,334	1.51%
91	OSM	15U	mxAA-	22,969,473	1.38%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,367,289	1.34%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,866,646	1.31%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,520,516	1.29%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,285,592	1.21%
91	MEDICA	20	AA (mex)	20,145,817	1.21%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	20,130,491	1.21%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,571,375	1.11%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	18,525,342	1.11%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,466,458	1.11%
91	SALUD	21	HR A+	18,075,915	1.08%
91	SALUD	20	HR A+	16,646,042	1.00%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,141,217	0.97%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	15,523,754	0.93%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,772,950	0.88%
91	FIHO	19	AA- (mex)	13,148,871	0.79%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	11,708,500	0.70%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	8,562,778	0.51%

91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,152,660	0.43%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,023,181	0.42%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,406,666	0.38%
91	GHEMA	23	HR BBB+	6,047,286	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,207,900	0.31%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,847,735	0.29%
91	NM	15	mxAA+	3,958,111	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,055,940	0.18%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,865,526	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,619,086	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,853,893	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,275,877	0.08%
91	GHOCB	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	733,852	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	617,373	0.04%
91	DMXI	15	mxD	413,094	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,870	0.00%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>89,826,317</b>	<b>5.38%</b>
BI	CETES	260416	AAA(mex)	42,518,155	2.54%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	32,786,028	1.96%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	14,522,134	0.87%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>31,756,296</b>	<b>1.90%</b>
1ISP	SHV	*	Alta	31,756,296	1.90%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales</b>			<b>14,605,816</b>	<b>0.87%</b>
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	14,605,816	0.87%
	<b>Udibonos</b>			<b>577,797,099</b>	<b>34.58%</b>
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	238,732,550	14.29%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	161,832,289	9.68%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	154,331,546	9.24%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	22,900,714	1.37%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>38,752,368</b>	<b>2.32%</b>
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	11,819,651	0.71%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,890,571	0.41%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,324,080	0.38%
95	CFE	15U	AAA (mex)	5,672,244	0.34%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,008,543	0.24%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	2,387,979	0.14%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,649,300	0.10%
	<b>Reportos</b>			<b>6,750,174</b>	<b>0.40%</b>
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	6,750,174	0.40%

<b>TOTAL CARTERA</b>	<b>1,671,076,694</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>	<b>1,714,133,043</b>	

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

---

**Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.636 %**  
**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."**

---