

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/7CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			390,671,183	23.23%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	156,842,639	9.33%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	112,961,409	6.72%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	73,531,623	4.37%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	32,900,668	1.96%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	14,434,844	0.86%
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			46,065,397	2.74%
CD	BANOB	21UX	AAA (mex)	26,892,915	1.60%
CD	BANOB	19UX	AAA (mex)	14,569,618	0.87%
CD	BACMEXT	14	AAA (mex)	4,602,864	0.27%
	Certificados Bursátiles Corporativos			475,836,484	28.29%
91	FIBRAHD	19U	HR AA	43,532,773	2.59%
91	RCO	18U	AAA (mex)	28,662,791	1.70%
91	ELEKTRA	22U	HR AA	25,619,322	1.52%
91	OSM	15U	mxAA-	23,485,952	1.40%
91	ARA	21-2X	AA- (mex)	22,769,836	1.35%
91	FUNO	16U	AAA (mex)	21,795,631	1.30%
91	GAP	23-2L	mxAAA	21,415,394	1.27%
91	ORBIA	22-2L	AAA (mex)	20,864,656	1.24%
91	MEDICA	20	AA (mex)	19,667,783	1.17%
91	AUNETCB	22U	AAA (mex)	19,408,903	1.15%
91	LAMOSA	19	AA (mex)	19,055,964	1.13%
91	ELEKTRA	22-2U	HR AA	18,947,072	1.13%
91	AGUA	17-2X	mxAA-	18,884,436	1.12%
91	SALUD	21	HR A+	18,089,083	1.08%
91	SALUD	20	HR A+	16,654,446	0.99%
91	STORAGE	21V	AA- (mex)	16,560,571	0.99%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	16,166,015	0.96%
91	FUNO	23L	AAA (mex)	14,369,729	0.85%
91	FIHO	19	AA- (mex)	12,886,856	0.77%
91	CMPC	23L	AAA (mex)	12,051,635	0.72%
91	EDUCA	23-2L	HR AA	9,031,821	0.54%

91	DANHOS	16	AAA (mex)	7,275,119	0.43%
91	FUNO	23-2L	AAA (mex)	7,028,350	0.42%
91	FUNO	13U	AAA (mex)	6,524,042	0.39%
91	GHEMA	23	HR BBB+	6,051,529	0.36%
91	DANHOS	17	AAA (mex)	5,315,690	0.32%
91	FSHOP	19U	A+ (mex)	4,891,024	0.29%
91	NM	15	mxAA+	3,990,525	0.24%
91	TENIXCB	14U	AAA (mex)	3,148,391	0.19%
91	FUNO	15	AAA (mex)	2,904,684	0.17%
91	ACOSTCB	15	AAA (mex)	2,648,297	0.16%
91	ALSEA	19-2	A+ (mex)	1,886,458	0.11%
91	RCO	12U	AAA (mex)	1,292,421	0.08%
91	GHO�B	14	HR D	1,139,092	0.07%
91	OSM	15	mxAA-	743,911	0.04%
91	CAMSCB	13U	AAA (mex)	633,501	0.04%
91	DMXI	15	mxD	440,894	0.03%
91	GAP	15-2	mxAAA	1,888	0.00%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			91,427,495	5.44%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	43,293,205	2.57%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	33,337,518	1.98%
BI	CETES	260611	AAA(mex)	14,796,772	0.88%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			17,857,468	1.06%
1ISP	SHV	*	Alta	17,857,468	1.06%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			15,020,773	0.89%
JI	CABEI	2-23S	mxAAA	15,020,773	0.89%
	Udibonos			575,999,987	34.25%
S	UDIBONO	431112	AAA(mex)	230,342,048	13.69%
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	163,845,405	9.74%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	158,515,578	9.42%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	23,296,955	1.39%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Fede			41,179,336	2.45%
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	12,025,220	0.72%
95	FEFA	24V	mxAAA	10,320,012	0.61%
95	PEMEX	14U	mxAAA	6,952,159	0.41%
95	FOVISCB	17-2U	Aaa.mx	6,253,445	0.37%
95	FOVISCB	19-2U	AAA (mex)	4,049,685	0.24%
95	TFOVIS	14U	AAA (mex)	1,578,817	0.09%
	Reportos			27,952,960	1.66%
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	27,952,960	1.66%
	TOTAL CARTERA			1,682,011,083	100.00%

ACTIVO NETO

1,682,429,101

Cartera al:

30/09/2024

Límite Máximo de VaR: 1.200 % Var Promedio: 0.598 %

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."
