

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/4CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			1,295,815,289	52.61%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	216,963,063	8.81%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	169,787,870	6.89%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	148,728,770	6.04%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	125,853,584	5.11%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	110,837,048	4.50%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	98,284,959	3.99%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	95,908,424	3.89%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	94,024,830	3.82%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	93,011,933	3.78%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	89,884,942	3.65%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	52,529,867	2.13%
	Certificados Bursátiles Corporativos			341,998,829	13.88%
91	LALA	18	AA (mex)	92,359,672	3.75%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,646,392	3.36%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	49,059,246	1.99%
91	TPLAYCB	24	HR AA	45,136,547	1.83%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,223,549	1.67%
91	BRX	22	AA (mex)	20,233,110	0.82%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,340,313	0.46%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			464,528,776	18.86%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	464,528,776	18.86%
	Chequera Dolares			153,217	0.01%
CHD	40-133	8034712		153,217	0.01%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,640,645	1.65%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,640,645	1.65%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			76,955,949	3.12%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	76,955,949	3.12%

	Reportos			243,146,349	9.87%
LD	BONDES	260212	AAA(mex)	105,080,228	4.27%
LF	BONDES	261008	AAA(mex)	99,743,676	4.05%
LF	BONDES	340323	AAA(mex)	38,322,445	1.56%
	TOTAL CARTERA			2,463,239,054	100.00%
	ACTIVO NETO			2,481,502,107	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % **Var Promedio:** 0.328 %
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."