

## DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>1,240,081,821</b>	<b>55.85%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	524,577,102	23.62%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	125,599,085	5.66%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	114,745,738	5.17%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	106,960,440	4.82%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	101,008,169	4.55%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	91,640,868	4.13%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	88,542,486	3.99%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	44,480,003	2.00%
M	BONOS	471107	AAA(mex)	42,527,932	1.92%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>241,683,534</b>	<b>10.88%</b>
91	LALA	18	AA (mex)	89,572,473	4.03%
91	GAP	24-2L	mxAAA	80,928,494	3.65%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,447,420	1.82%
91	BRX	22	AAA (mex)	19,779,614	0.89%
91	FUNO	15	AAA (mex)	10,955,533	0.49%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>98,325,330</b>	<b>4.43%</b>
BI	CETES	240613	AAA(mex)	98,325,330	4.43%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>1,091,589</b>	<b>0.05%</b>
CHD	40-133	8034712		1,091,589	0.05%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>39,126,188</b>	<b>1.76%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	39,126,188	1.76%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>20,062,790</b>	<b>0.90%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	20,062,790	0.90%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>226,081,682</b>	<b>10.18%</b>
95	PEMEX	13-2	mxAAA	148,265,862	6.68%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	77,815,820	3.50%

	<b>Reportos</b>			<b>354,034,017</b>	<b>15.94%</b>
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	354,034,017	15.94%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,220,486,951</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,220,098,775</b>	

**Cartera al: 18/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.181 %**  
**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."**