

### DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>498,647</b>	<b>7.28%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	498,647	7.28%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>5,020,461</b>	<b>73.33%</b>
BI	CETES	251224	AAA(mex)	5,020,461	73.33%
	<b>Reportos</b>			<b>1,327,196</b>	<b>19.39%</b>
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	1,327,196	19.39%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>6,846,304</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>6,881,868</b>	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 0.500 % Var Promedio: 0.089 %

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."