

## 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>1,411,000,011</b>	<b>61.42%</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	526,694,178	22.93%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	149,780,267	6.52%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	125,830,088	5.48%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	114,768,295	5.00%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	107,441,144	4.68%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	101,363,931	4.41%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	100,954,217	4.39%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	88,794,852	3.87%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	44,516,485	1.94%
M	BONOS	471107	AAA(mex)	42,639,309	1.86%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	8,217,246	0.36%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>241,994,269</b>	<b>10.53%</b>
91	LALA	18	AA (mex)	89,591,398	3.90%
91	GAP	24-2L	mxAAA	81,074,530	3.53%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,521,036	1.76%
91	BRX	22	AAA (mex)	19,821,327	0.86%
91	FUNO	15	AAA (mex)	10,985,978	0.48%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>98,722,650</b>	<b>4.30%</b>
BI	CETES	240613	AAA(mex)	98,722,650	4.30%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>1,096,122</b>	<b>0.05%</b>
CHD	40-133	8034712		1,096,122	0.05%
	<b>Titulos de Credito Extranjeros</b>			<b>39,233,844</b>	<b>1.71%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	39,233,844	1.71%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>20,153,459</b>	<b>0.88%</b>
93	TPLAY	00223	HR2	20,153,459	0.88%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>223,549,167</b>	<b>9.73%</b>
95	PEMEX	13-2	mxAAA	148,930,760	6.48%

95	CFE	20-2	AAA (mex)	74,618,407	3.25%
	<b>Reportos</b>			<b>261,602,255</b>	<b>11.39%</b>
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	248,046,386	10.80%
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	13,555,869	0.59%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,297,351,777</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,296,528,439</b>	

**Cartera al:** 30/04/2024

**Límite Máximo de VaR:** 0.830 % **Var Promedio:** 0.208 %  
**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."