

### MEDIANO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos De Protección Al Ahorro Con Pago Trimestral De Ir</b>			<b>50,990,050</b>	<b>1.87%</b>
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	50,990,050	1.87%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>515,360,778</b>	<b>18.91%</b>
BI	CETES	251030	AAA(mex)	170,651,700	6.26%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	139,064,595	5.10%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	49,592,695	1.82%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	45,598,205	1.67%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	45,503,030	1.67%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	40,803,430	1.50%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	24,147,123	0.89%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>108,448</b>	<b>0.00%</b>
CHD	40-133	8031130		108,448	0.00%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>167,411,057</b>	<b>6.14%</b>
93	START	00224	HR+1	27,012,750	0.99%
93	START	04223	HR+1	24,486,191	0.90%
93	GMFIN	00324	F1+ (mex)	19,570,012	0.72%
93	GMFIN	03624	F1+ (mex)	18,897,914	0.69%
93	START	00724	HR+1	18,009,864	0.66%
93	GMFIN	01224	F1+ (mex)	15,244,951	0.56%
93	START	00324	HR+1	12,279,786	0.45%
93	START	00424	F1+ (mex)	10,049,043	0.37%
93	GMFIN	04524	F1+ (mex)	9,447,572	0.35%
93	GMFIN	13023	F1+ (mex)	7,281,054	0.27%
93	GMFIN	12723	F1+ (mex)	3,113,067	0.11%
93	GMFIN	12423	F1+ (mex)	2,018,855	0.07%
	<b>Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)</b>			<b>152,845,868</b>	<b>5.61%</b>
I	BANREG	24324	F1+ (mex)	51,491,463	1.89%
I	BANREG	24454	F1+ (mex)	50,929,331	1.87%
I	BANREG	24191	F1+ (mex)	50,425,075	1.85%

	<b>Reportos</b>			<b>940,809,944</b>	<b>34.52%</b>
BI	CETES	241003	AAA(mex)	409,385,629	15.02%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	206,474,675	7.58%
LD	BONDES	250814	AAA(mex)	186,178,173	6.83%
LD	BONDES	240530	AAA(mex)	70,717,865	2.60%
BI	CETES	241003	AAA(mex)	68,053,603	2.50%
	<b>Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal</b>			<b>897,984,437</b>	<b>32.95%</b>
LF	BONDES	270225	AAA(mex)	499,105,325	18.31%
LF	BONDES	270318	AAA(mex)	100,028,403	3.67%
LF	BONDES	270422	AAA(mex)	99,804,193	3.66%
LF	BONDES	270819	AAA(mex)	99,527,361	3.65%
LF	BONDES	281228	AAA(mex)	99,519,155	3.65%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,725,510,582</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,726,616,081</b>	

Cartera al: 02/05/2024

**Límite Máximo de VaR: 0.250 % Var Promedio: 0.011 %**  
**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."**