

## MEDIANO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos Gob.Federal Colocados en el Exterior UMS (€</b>			<b>165,102,362</b>	<b>9.63%</b>
D1SP	MEXU44	280209	BBB	59,746,137	3.48%
D1SP	MEXE02	280111	BBB	56,997,543	3.32%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	48,358,682	2.82%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>357,595,243</b>	<b>20.85%</b>
CHD	40-110	9730985		348,033,717	20.29%
CHD	40-133	8019341		9,561,526	0.56%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio :</b>			<b>527,198,563</b>	<b>30.74%</b>
D2SP	LIVVE96	241002	BBB	176,614,106	10.30%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	108,313,437	6.32%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	55,159,242	3.22%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	53,662,838	3.13%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	41,314,294	2.41%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	19,721,953	1.15%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	19,064,227	1.11%
D2SP	TERRB59	290718	BBB-	18,814,820	1.10%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	17,857,289	1.04%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	11,310,949	0.66%
D2SP	CEMEA69	250721	BBB-	4,972,382	0.29%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	393,025	0.02%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>473,284,612</b>	<b>27.59%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	282,865,013	16.49%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	190,419,600	11.10%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>191,624,626</b>	<b>11.17%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	97,603,798	5.69%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	94,020,828	5.48%
	<b>Reportos</b>			<b>337,662</b>	<b>0.02%</b>
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	337,662	0.02%

TOTAL CARTERA	1,715,143,068	100.00%
ACTIVO NETO	1,726,101,120	

Cartera al: 19/09/2024

---

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.111 %  
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."