

**MEDIANO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES**

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos Gob.Federal Colocados en el Exterior UMS (Spot)</b>			<b>212,611,622</b>	<b>14.18%</b>
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	110,563,640	7.38%
D1SP	MEXU44	280209	BBB	56,235,530	3.75%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	45,812,453	3.06%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>217,928,900</b>	<b>14.54%</b>
CHD	40-110	9730985		202,771,772	13.53%
CHD	40-133	8019341		15,157,128	1.01%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>442,825,251</b>	<b>29.54%</b>
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	165,699,709	11.05%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	99,856,841	6.66%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	51,368,790	3.43%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	48,522,269	3.24%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	38,800,289	2.59%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	16,634,297	1.11%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	11,047,771	0.74%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	10,525,045	0.70%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	370,239	0.03%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>447,411,951</b>	<b>29.84%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	265,188,139	17.69%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	182,223,812	12.16%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>178,330,565</b>	<b>11.90%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	92,529,122	6.17%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	85,801,443	5.72%
	<b>Reportos</b>			<b>92,334</b>	<b>0.01%</b>
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	92,334	0.01%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,499,200,623</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,495,807,464</b>	

Cartera al:

20/06/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 0.996 %**

**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."**