

**MEDIANO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES**

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob.Federal Colocados en el Exterior UMS (Spot)			100,679,156	6.72%
D1SP	MEXU44	280209	BBB	55,522,130	3.71%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	45,157,025	3.01%
	Chequera Dolares			341,501,099	22.79%
CHD	40-110	9730985		324,190,676	21.63%
CHD	40-133	8019341		17,310,423	1.16%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			440,115,452	29.37%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	162,990,689	10.88%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	99,163,366	6.62%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	50,654,460	3.38%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	47,992,893	3.20%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	38,073,026	2.54%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	16,437,071	1.10%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	14,019,146	0.94%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	10,427,860	0.70%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	356,939	0.02%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			440,051,639	29.37%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	260,979,214	17.42%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	179,072,426	11.95%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			176,091,752	11.75%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	91,197,224	6.09%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	84,894,529	5.67%
	Reportos			89,598	0.01%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	89,598	0.01%
	TOTAL CARTERA			1,498,528,696	100.00%
	ACTIVO NETO			1,497,713,738	

Cartera al:

18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.054 %

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."