

MEDIANO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Bonos Gob.Federal Colocados en el Exterior UMS (Spot)				167,051,354	9.72%
D1SP	MEXU44	280209	BBB	60,357,054	3.51%
D1SP	MEXE02	280111	BBB	57,601,180	3.35%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	49,093,120	2.86%
Chequera Dolares				359,540,080	20.91%
CHD	40-110	9730985		355,918,348	20.70%
CHD	40-133	8019341		3,621,733	0.21%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				516,275,426	30.03%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	179,876,020	10.46%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	110,212,865	6.41%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	56,207,739	3.27%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	53,536,631	3.11%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	42,085,196	2.45%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	20,067,734	1.17%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	19,155,753	1.11%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	18,167,275	1.06%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	11,509,216	0.67%
D2SP	CEMEA69	250721	BBB-	5,059,133	0.29%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	397,863	0.02%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				482,317,222	28.05%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	288,393,805	16.77%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	193,923,417	11.28%
Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)				194,073,034	11.29%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	99,042,876	5.76%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	95,030,158	5.53%
Reportos				153,188	0.01%
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	153,188	0.01%
TOTAL CARTERA				1,719,410,304	100.00%

ACTIVO NETO

1,719,298,417

Cartera al:

30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.047 %

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."