

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)				143,175,457	9.90%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	100,999,024	6.98%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	42,176,433	2.92%
Chequera Dolares				119,510,286	8.26%
CHD	40-110	9730985		103,523,551	7.16%
CHD	40-133	8019341		15,986,735	1.11%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				604,918,673	41.82%
D2SP	SANTM18	240524	A	173,999,135	12.03%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	153,195,729	10.59%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	96,472,424	6.67%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	47,605,803	3.29%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	46,413,911	3.21%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	36,541,780	2.53%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	25,463,022	1.76%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,241,261	1.05%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,652,352	0.67%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	333,257	0.02%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				414,020,787	28.63%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	245,398,262	16.97%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	168,622,524	11.66%
Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)				164,565,159	11.38%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	85,383,083	5.90%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	79,182,076	5.47%
Reportos				194,286	0.01%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	194,286	0.01%
TOTAL CARTERA				1,446,384,648	100.00%
ACTIVO NETO				1,433,430,109	

Cartera al:

30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.014 %

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."