

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)				142,730,699	10.04%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	100,607,541	7.08%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	42,123,158	2.96%
Chequera Dolares				291,302,044	20.49%
CHD	40-110	9730985		289,157,136	20.34%
CHD	40-133	8019341		2,144,908	0.15%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				412,189,162	29.00%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	152,482,014	10.73%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	95,955,077	6.75%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	47,071,781	3.31%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	44,823,408	3.15%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	36,564,077	2.57%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,259,380	1.07%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	10,014,563	0.71%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,679,062	0.68%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	339,799	0.02%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				412,131,234	28.99%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	244,282,412	17.19%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	167,848,822	11.81%
Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)				163,124,745	11.48%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	85,078,414	5.99%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	78,046,331	5.49%
Reportos				30,991	0.00%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	30,991	0.00%
TOTAL CARTERA				1,421,508,875	100.00%
ACTIVO NETO				1,417,980,407	

Cartera al:

31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.011 %

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."