

## 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>211,566,148</b>	<b>14.28%</b>
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	109,976,109	7.42%
D1SP	MEXU44	280209	BBB	55,925,600	3.77%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	45,664,440	3.08%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>205,003,895</b>	<b>13.83%</b>
CHD	40-110	9730985		202,114,970	13.64%
CHD	40-133	8019341		2,888,925	0.20%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>441,766,240</b>	<b>29.81%</b>
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	165,176,493	11.15%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	99,832,887	6.74%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	51,270,528	3.46%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	48,284,389	3.26%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	38,666,901	2.61%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	16,607,351	1.12%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	11,015,426	0.74%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	10,544,802	0.71%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	367,463	0.03%
<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>446,030,206</b>	<b>30.10%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	264,380,040	17.84%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	181,650,166	12.26%
<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>177,458,136</b>	<b>11.97%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	92,196,484	6.22%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	85,261,652	5.75%
<b>Reportos</b>				<b>271,800</b>	<b>0.02%</b>
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	271,800	0.02%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,482,096,425</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>1,482,129,173</b>	

Cartera al:

28/06/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.012 %**

**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."**