

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)				265,492,298	15.08%
D1SP	MEXF76	290422	BBB	96,659,824	5.49%
D1SP	MEXU44	280209	BBB	60,835,933	3.46%
D1SP	MEXE02	280111	BBB	58,046,636	3.30%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	49,949,905	2.84%
Chequera Dolares				372,429,614	21.15%
CHD	40-110	9730985		357,987,137	20.33%
CHD	40-133	8019341		14,442,477	0.82%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				437,259,716	24.83%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	112,168,754	6.37%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	56,943,317	3.23%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	54,667,972	3.11%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	42,857,569	2.43%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	29,849,874	1.70%
D2SP	AMXLH79	290422	Baa1	28,259,347	1.61%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	19,867,491	1.13%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	19,567,517	1.11%
D2SP	TERRB59	290718	BBB	19,398,520	1.10%
D2SP	ALPEC49	290918	BBB-	18,709,604	1.06%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	17,995,125	1.02%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	11,421,664	0.65%
D2SP	CEMEA69	250721	BBB-	5,150,575	0.29%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	402,386	0.02%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				490,664,660	27.87%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	293,199,461	16.65%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	197,465,200	11.21%
Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)				194,872,513	11.07%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	100,466,690	5.71%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	94,405,823	5.36%

	Reportos			97,187	0.01%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	97,187	0.01%
	TOTAL CARTERA			1,760,815,988	100.00%
	ACTIVO NETO			1,755,810,481	
	Cartera al:	07/11/2024			

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.198 %
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."