

**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>98,644,081</b>	<b>6.98%</b>
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	98,644,081	6.98%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>180,921,831</b>	<b>12.79%</b>
CHD	40-110	9730985		164,656,387	11.64%
CHD	40-133	8019341		16,265,444	1.15%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>580,248,430</b>	<b>41.03%</b>
D2SP	SANTM18	240524	A	166,460,411	11.77%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	146,468,757	10.36%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	92,565,095	6.55%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	45,671,268	3.23%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	44,794,655	3.17%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	35,118,394	2.48%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	24,246,598	1.72%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,057,758	1.07%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,542,410	0.68%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	323,084	0.02%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>396,361,563</b>	<b>28.03%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	235,000,195	16.62%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	161,361,369	11.41%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>157,859,297</b>	<b>11.16%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	81,805,082	5.79%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	76,054,215	5.38%
	<b>Reportos</b>			<b>51,876</b>	<b>0.00%</b>
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	51,876	0.00%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,414,087,078</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,417,329,191</b>	

**Cartera al:**

**11/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.001 %**

**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."**