

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)			99,658,530	7.00%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	99,658,530	7.00%
	Chequera Dolares			266,172,322	18.68%
CHD	40-110	9730985		249,697,789	17.53%
CHD	40-133	8019341		16,474,533	1.16%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			586,975,802	41.20%
D2SP	SANTM18	240524	A	167,456,831	11.75%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	150,396,154	10.56%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	93,417,797	6.56%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	45,882,017	3.22%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	44,836,192	3.15%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	35,369,381	2.48%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	24,463,988	1.72%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,192,401	1.07%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,630,942	0.68%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	330,099	0.02%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			162,387,747	11.40%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	162,387,747	11.40%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			160,798,325	11.29%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	82,839,446	5.82%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	77,958,879	5.47%
	Títulos Emisoras Extranjeras SPOT			148,290,293	10.41%
D8SP	KIMBER2	1-22	A-	148,290,293	10.41%
	Reportos			357,804	0.03%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	357,804	0.03%
	TOTAL CARTERA			1,424,640,823	100.00%
	ACTIVO NETO			1,425,931,814	

Cartera al:

27/03/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.074 %

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."