

## MEDIANO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Bonos Gob.Federal Colocados en el Exterior UMS (Spot)</b>				<b>173,340,694</b>	<b>9.64%</b>
D1SP	MEXU44	280209	BBB	62,349,445	3.47%
D1SP	MEXE02	280111	BBB	59,628,864	3.32%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	51,362,386	2.86%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>472,082,782</b>	<b>26.25%</b>
CHD	40-110	9730985		470,558,075	26.16%
CHD	40-133	8019341		1,524,707	0.09%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>447,917,298</b>	<b>24.91%</b>
D2SP	ALSEA53	261214	BB	115,633,653	6.43%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	58,009,001	3.23%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	54,711,418	3.04%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	44,121,693	2.45%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	30,757,906	1.71%
D2SP	AMXLH79	290422	Baa1	28,997,209	1.61%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	20,439,364	1.14%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	20,137,309	1.12%
D2SP	TERRB59	290718	BBB	19,965,129	1.11%
D2SP	ALPEC49	290918	BBB-	19,211,427	1.07%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	18,492,858	1.03%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	11,720,792	0.65%
D2SP	CEMEA69	250721	BBB-	5,305,314	0.30%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	414,226	0.02%
<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>504,923,645</b>	<b>28.07%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	301,730,391	16.78%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	203,193,254	11.30%
<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>200,177,757</b>	<b>11.13%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	103,280,856	5.74%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	96,896,901	5.39%
<b>Reportos</b>				<b>97,316</b>	<b>0.01%</b>

IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	97,316	0.01%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,798,539,492</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,815,446,043</b>	

**Cartera al: 14/11/2024**

**Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.204 %**  
**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."**