

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)				141,001,809	10.01%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	99,328,330	7.05%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	41,673,479	2.96%
Chequera Dolares				104,009,950	7.38%
CHD	40-110	9730985		100,879,480	7.16%
CHD	40-133	8019341		3,130,470	0.22%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				594,427,039	42.18%
D2SP	SANTM18	240524	A	170,771,749	12.12%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	150,556,994	10.68%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	94,781,626	6.73%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	46,853,012	3.33%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	45,709,841	3.24%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	36,070,448	2.56%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	24,705,357	1.75%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,067,763	1.07%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,574,015	0.68%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	336,234	0.02%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				406,547,147	28.85%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	241,018,438	17.10%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	165,528,709	11.75%
Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)				162,450,392	11.53%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	84,057,791	5.97%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	78,392,601	5.56%
Reportos				752,967	0.05%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	752,967	0.05%
TOTAL CARTERA				1,409,189,304	100.00%
ACTIVO NETO				1,406,244,656	

Cartera al:

09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.046 %

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."