

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)				213,198,994	14.29%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	110,892,770	7.43%
D1SP	MEXU44	280209	BBB	56,369,586	3.78%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	45,936,638	3.08%
Chequera Dolares				206,295,331	13.83%
CHD	40-110	9730985		203,387,062	13.64%
CHD	40-133	8019341		2,908,270	0.20%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				444,474,852	29.80%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	166,193,586	11.14%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	100,485,847	6.74%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	51,616,135	3.46%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	48,574,173	3.26%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	38,837,575	2.60%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	16,711,034	1.12%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	11,087,565	0.74%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	10,599,478	0.71%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	369,459	0.03%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				448,825,805	30.09%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	266,036,824	17.84%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	182,788,981	12.25%
Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)				178,576,940	11.97%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	92,778,780	6.22%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	85,798,160	5.75%
Reportos				271,551	0.02%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	271,551	0.02%
TOTAL CARTERA				1,491,643,473	100.00%
ACTIVO NETO				1,490,786,011	

Cartera al:

27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.010 %

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."