

## 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>169,683,296</b>	<b>9.58%</b>
D1SP	MEXU44	280209	BBB	61,086,274	3.45%
D1SP	MEXE02	280111	BBB	58,336,568	3.29%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	50,260,454	2.84%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>471,349,802</b>	<b>26.61%</b>
CHD	40-110	9730985		462,307,476	26.10%
CHD	40-133	8019341		9,042,326	0.51%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>440,060,635</b>	<b>24.84%</b>
D2SP	ALSEA53	261214	BB	112,735,167	6.36%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	57,258,839	3.23%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	55,070,674	3.11%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	43,118,939	2.43%
D2SP	KUOBF33	270707	BB	30,071,680	1.70%
D2SP	AMXLH79	290422	Baa1	28,480,572	1.61%
D2SP	CYDSA81	271004	BB+	19,968,498	1.13%
D2SP	LIVEF61	261006	BBB	19,698,563	1.11%
D2SP	TERRB59	290718	BBB	19,586,966	1.11%
D2SP	ALPEC49	290918	BBB-	18,909,540	1.07%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	18,095,662	1.02%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	11,475,900	0.65%
D2SP	CEMEA69	250721	BBB-	5,181,892	0.29%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	407,743	0.02%
<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>493,724,053</b>	<b>27.87%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	295,033,868	16.65%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	198,690,185	11.22%
<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>196,502,251</b>	<b>11.09%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	101,133,042	5.71%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	95,369,209	5.38%
<b>Reportos</b>				<b>205,584</b>	<b>0.01%</b>

IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	205,584	0.01%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,771,525,621</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>1,770,279,945</b>	

**Cartera al:** 31/10/2024

**Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.252 %**  
**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."**