

**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)			142,190,759	9.99%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	100,298,074	7.05%
D1SP	MEXG29	260121	BBB	41,892,685	2.94%
	Chequera Dolares			106,587,836	7.49%
CHD	40-110	9730985		101,993,059	7.16%
CHD	40-133	8019341		4,594,776	0.32%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			600,038,833	42.15%
D2SP	SANTM18	240524	A	172,583,692	12.12%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	151,991,309	10.68%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	95,658,159	6.72%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	47,250,589	3.32%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	46,071,024	3.24%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	36,420,988	2.56%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	24,997,204	1.76%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,134,733	1.06%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,599,901	0.67%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	331,236	0.02%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			410,975,988	28.87%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	243,633,890	17.11%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	167,342,098	11.75%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			163,692,383	11.50%
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	84,901,224	5.96%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	78,791,159	5.53%
	Reportos			194,344	0.01%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	194,344	0.01%
	TOTAL CARTERA			1,423,680,143	100.00%
	ACTIVO NETO			1,423,304,157	

Cartera al:

02/05/2024

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."