

**MEDIANO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES**

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos Gob.Federal Colocados en el Exterior UMS (Spot)</b>			<b>102,452,228</b>	<b>6.99%</b>
D1SP	MEXJ98	250427	BBB	102,452,228	6.99%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>187,247,675</b>	<b>12.77%</b>
CHD	40-110	9730985		171,050,668	11.67%
CHD	40-133	8019341		16,197,007	1.11%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>600,883,582</b>	<b>40.99%</b>
D2SP	SANTM18	240524	A	172,887,593	11.79%
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	152,165,110	10.38%
D2SP	ALSEA53	261214	BB	95,600,793	6.52%
D2SP	ORBIB11	260511	BBB	47,344,815	3.23%
D2SP	SFCCA29	280513	BBB	46,308,009	3.16%
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	36,481,722	2.49%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	25,118,370	1.71%
D2SP	PEMEH20	251016	BBB	15,084,293	1.03%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	9,560,324	0.65%
D2SP	TIGOB60	280115	BB+	332,554	0.02%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>411,694,298</b>	<b>28.08%</b>
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	244,076,994	16.65%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	167,617,305	11.43%
	<b>Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>163,777,823</b>	<b>11.17%</b>
D5SP	TNOTV46	260131	AA+	84,936,977	5.79%
D5SP	TNOTS61	290531	AA+	78,840,846	5.38%
	<b>Reportos</b>			<b>51,968</b>	<b>0.00%</b>
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	51,968	0.00%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,466,107,574</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,464,071,140</b>	

**Cartera al:**

**18/04/2024**

**Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.003 %**

**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."**