

LARGO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/2LP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			148,185,297	12.18%
CHD	40-110	8377972		135,990,746	11.18%
CHD	40-133	8255952		12,194,551	1.00%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			1,032,299,240	84.86%
D2SP	AMZSQ73	291201	A1	51,569,338	4.24%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	49,355,817	4.06%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	42,003,999	3.45%
D2SP	AXPG27	240730	BBB+	41,609,128	3.42%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	41,472,454	3.41%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	41,404,837	3.40%
D2SP	TGTD76	240701	A	41,143,829	3.38%
D2SP	ORCLU90	240708	BBB	41,068,039	3.38%
D2SP	BKN70	250424	A	41,005,747	3.37%
D2SP	VZR33	241101	BBB+	40,395,747	3.32%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	40,081,204	3.30%
D2SP	WMRN95	290708	AA	40,065,201	3.29%
D2SP	PFET61	290315	A	39,966,997	3.29%
D2SP	PMJ63	290815	A-	39,323,081	3.23%
D2SP	HONE43	270301	A	38,325,173	3.15%
D2SP	UNHP53	250715	A+	37,993,818	3.12%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	36,787,840	3.02%
D2SP	DEU09	240910	A	33,440,750	2.75%
D2SP	CRMF13	280411	A+	32,625,025	2.68%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	32,522,906	2.67%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	32,346,347	2.66%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	32,289,205	2.65%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	32,109,801	2.64%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	32,005,950	2.63%
D2SP	HDH36	280915	A	29,515,955	2.43%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	24,730,522	2.03%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	24,642,781	2.03%
D2SP	TG64	280201	BBB	22,497,747	1.85%

	Títulos Emisoras Extranjeras SPOT			32,048,859	2.64%
D8SP	MS	1-19	A-	32,048,859	2.64%
	Reportos			3,950,905	0.33%
LD	BONDESD	260409	AAA(mex)	3,950,905	0.33%
	TOTAL CARTERA			1,216,484,301	100.00%
	ACTIVO NETO			1,217,053,113	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % **Var Promedio:** 1.063 %
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."