

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			329,940,212	15.44%
CHD	40-110	8377972		328,715,544	15.38%
CHD	40-133	8255952		1,224,668	0.06%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio :			1,141,772,637	53.42%
D2SP	AMZNQ73	291201	A1	60,781,870	2.84%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	57,008,693	2.67%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	48,855,186	2.29%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	48,376,402	2.26%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	48,095,293	2.25%
D2SP	WMRN95	290708	AA	47,784,781	2.24%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	47,767,284	2.24%
D2SP	BKN70	250424	A	47,647,426	2.23%
D2SP	PFET61	290315	A	47,345,014	2.22%
D2SP	VZR33	241101	BBB+	46,806,935	2.19%
D2SP	PMJ63	290815	A-	46,662,056	2.18%
D2SP	HONE43	270301	A	45,229,833	2.12%
D2SP	UNHP53	250715	A+	43,508,167	2.04%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	42,194,309	1.97%
D2SP	CRMF13	280411	A+	39,019,250	1.83%
D2SP	ORCLT19	250401	BBB	38,544,769	1.80%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	38,358,892	1.80%
D2SP	AAPLY53	260223	AA+	38,286,931	1.79%
D2SP	KOE82	270525	A+	38,067,182	1.78%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	38,054,728	1.78%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	38,049,890	1.78%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	37,955,629	1.78%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	37,677,642	1.76%
D2SP	HDH36	280915	A	35,249,480	1.65%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	28,886,542	1.35%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	28,827,404	1.35%
D2SP	TG64	280201	BBB	26,731,049	1.25%
	Treasury Bonds (Tipo de Cambio Spot)			113,314,403	5.30%

D6SP	TBONE01	440215	AA+	113,314,403	5.30%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			515,004,863	24.10%
D5SP	TNOTB28	270731	AA+	189,586,800	8.87%
D5SP	TNOTS30	291115	AA+	187,062,338	8.75%
D5SP	TNOTZ59	340215	AA+	138,355,725	6.47%
	Títulos Emisoras Extranjeras SPOT			37,139,956	1.74%
D8SP	MS	1-19	A-	37,139,956	1.74%
	Reportos			236,649	0.01%
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	236,649	0.01%
	TOTAL CARTERA			2,137,408,720	100.00%
	ACTIVO NETO			2,187,346,367	
	Cartera al:	19/09/2024			

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.231 %

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."