

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			167,211,282	11.98%
CHD	40-110	8377972		162,133,408	11.62%
CHD	40-133	8255952		5,077,875	0.36%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			1,009,124,146	72.33%
D2SP	AMZNQ73	291201	A1	54,762,048	3.93%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	52,564,265	3.77%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	44,452,925	3.19%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	44,330,386	3.18%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	44,033,069	3.16%
D2SP	BKN70	250424	A	43,906,867	3.15%
D2SP	PFET61	290315	A	43,578,993	3.12%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	43,505,951	3.12%
D2SP	VZR33	241101	BBB+	43,217,062	3.10%
D2SP	WMRN95	290708	AA	42,879,589	3.07%
D2SP	PMJ63	290815	A-	42,776,959	3.07%
D2SP	HONE43	270301	A	41,375,532	2.97%
D2SP	UNHP53	250715	A+	39,991,545	2.87%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	39,396,361	2.82%
D2SP	DEU09	240910	A	35,780,638	2.56%
D2SP	CRMF13	280411	A+	35,410,136	2.54%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	34,965,832	2.51%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	34,744,454	2.49%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	34,614,346	2.48%
D2SP	KOE82	270525	A+	34,579,369	2.48%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	34,490,463	2.47%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	34,327,359	2.46%
D2SP	HDH36	280915	A	32,093,805	2.30%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	26,652,249	1.91%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	26,259,561	1.88%
D2SP	TG64	280201	BBB	24,434,384	1.75%
	Treasury Bonds (Tipo de Cambio Spot)			101,900,705	7.30%
D6SP	TBONE01	440215	AA+	101,900,705	7.30%

	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			78,192,208	5.60%
D5SP	TNOTZ59	340215	AA+	54,096,616	3.88%
D5SP	TNOTS30	291115	AA+	24,095,592	1.73%
	Títulos Emisoras Extranjeras SPOT			34,288,792	2.46%
D8SP	MS	1-19	A-	34,288,792	2.46%
	Reportos			4,522,534	0.32%
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	4,522,534	0.32%
	TOTAL CARTERA			1,395,239,667	100.00%
	ACTIVO NETO			1,401,435,232	

Cartera al: 18/07/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.104 %
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."