

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			147,719,445	12.08%
CHD	40-110	8377972		137,901,156	11.28%
CHD	40-133	8255952		9,818,288	0.80%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			1,038,758,495	84.96%
D2SP	AMZSQ73	291201	A1	51,624,604	4.22%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	49,684,751	4.06%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	42,245,930	3.46%
D2SP	AXPG27	240730	BBB+	41,902,403	3.43%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	41,761,037	3.42%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	41,544,910	3.40%
D2SP	TGTD76	240701	A	41,457,909	3.39%
D2SP	VZR33	241101	BBB+	41,388,831	3.39%
D2SP	ORCLU90	240708	BBB	41,355,006	3.38%
D2SP	BKN70	250424	A	41,252,664	3.37%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	40,920,019	3.35%
D2SP	WMRN95	290708	AA	40,113,812	3.28%
D2SP	PFET61	290315	A	40,058,022	3.28%
D2SP	PMJ63	290815	A-	39,388,645	3.22%
D2SP	HONE43	270301	A	38,452,868	3.15%
D2SP	UNHP53	250715	A+	38,240,714	3.13%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	37,000,119	3.03%
D2SP	DEU09	240910	A	33,689,127	2.76%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	32,737,673	2.68%
D2SP	CRMF13	280411	A+	32,715,174	2.68%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	32,546,010	2.66%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	32,488,095	2.66%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	32,263,749	2.64%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	32,174,022	2.63%
D2SP	HDH36	280915	A	29,583,041	2.42%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	24,834,981	2.03%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	24,758,148	2.03%
D2SP	TG64	280201	BBB	22,576,230	1.85%

	Títulos Emisoras Extranjeras SPOT			32,290,505	2.64%
D8SP	MS	1-19	A-	32,290,505	2.64%
	Reportos			3,949,754	0.32%
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	3,949,754	0.32%
	TOTAL CARTERA			1,222,718,199	100.00%
	ACTIVO NETO			1,222,846,625	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % **Var Promedio:** 1.025 %
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."