

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				176,249,692	14.13%
CHD	40-110	8377972		171,185,816	13.72%
CHD	40-133	8255952		5,063,876	0.41%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				1,033,391,153	82.85%
D2SP	AMZSQ73	291201	A1	51,288,690	4.11%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	49,441,102	3.96%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	42,006,225	3.37%
D2SP	AXPG27	240730	BBB+	41,667,086	3.34%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	41,525,214	3.33%
D2SP	BKN70	250424	A	41,413,460	3.32%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	41,261,485	3.31%
D2SP	TGTD76	240701	A	41,201,573	3.30%
D2SP	VZR33	241101	BBB+	41,156,758	3.30%
D2SP	ORCLU90	240708	BBB	41,108,429	3.30%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	40,717,885	3.26%
D2SP	WMRN95	290708	AA	39,878,920	3.20%
D2SP	PFET61	290315	A	39,793,810	3.19%
D2SP	PMJ63	290815	A-	39,015,838	3.13%
D2SP	HONE43	270301	A	38,252,776	3.07%
D2SP	UNHP53	250715	A+	38,003,780	3.05%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	36,769,534	2.95%
D2SP	DEU09	240910	A	33,501,348	2.69%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	32,988,018	2.65%
D2SP	CRMF13	280411	A+	32,602,300	2.61%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	32,337,768	2.59%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	32,283,352	2.59%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	32,066,319	2.57%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	32,008,062	2.57%
D2SP	HDH36	280915	A	29,389,566	2.36%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	24,697,887	1.98%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	24,617,131	1.97%
D2SP	TG64	280201	BBB	22,396,836	1.80%

	Títulos Emisoras Extranjeras SPOT			32,684,062	2.62%
D8SP	MS	1-19	A-	32,684,062	2.62%
	Reportos			5,014,810	0.40%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	5,014,810	0.40%
	TOTAL CARTERA			1,247,339,717	100.00%
	ACTIVO NETO			1,245,889,417	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % **Var Promedio:** 1.006 %
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."