

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			388,217,990	15.70%
CHD	40-110	8377972		368,380,863	14.90%
CHD	40-133	8255952		19,837,127	0.80%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			1,145,117,236	46.31%
D2SP	AMZNQ73	291201	A1	62,998,828	2.55%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	60,343,957	2.44%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	51,404,834	2.08%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	50,883,268	2.06%
D2SP	BKN70	250424	A	50,439,008	2.04%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	49,757,445	2.01%
D2SP	WMRN95	290708	AA	49,325,162	2.00%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	49,248,127	1.99%
D2SP	PFET61	290315	A	49,119,012	1.99%
D2SP	PMJ63	290815	A-	48,640,833	1.97%
D2SP	HONE43	270301	A	47,453,252	1.92%
D2SP	UNHP53	250715	A+	46,270,624	1.87%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	44,910,455	1.82%
D2SP	ORCLT19	250401	BBB	40,597,056	1.64%
D2SP	AAPLY53	260223	AA+	40,556,932	1.64%
D2SP	KOE82	270525	A+	40,008,583	1.62%
D2SP	CRMF13	280411	A+	39,986,407	1.62%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	39,951,803	1.62%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	39,870,349	1.61%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	39,797,188	1.61%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	39,555,950	1.60%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	39,450,251	1.60%
D2SP	HDH36	280915	A	36,585,794	1.48%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	30,227,223	1.22%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	29,763,944	1.20%
D2SP	TG64	280201	BBB	27,970,951	1.13%
	Treasury Bonds (Tipo de Cambio Spot)			112,337,485	4.54%
D6SP	TBONE01	440215	AA+	112,337,485	4.54%

	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			826,859,268	33.44%
D5SP	TNOTB05	290815	AA+	236,693,019	9.57%
D5SP	TNOTZ59	340215	AA+	199,792,790	8.08%
D5SP	TNOTB28	270731	AA+	198,058,933	8.01%
D5SP	TNOTS30	291115	AA+	192,314,526	7.78%
	Reportos			85,942	0.00%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	85,942	0.00%
	TOTAL CARTERA			2,472,617,921	100.00%
	ACTIVO NETO			2,472,515,844	
	Cartera al:	14/11/2024			

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.326 %
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."