

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 | | | 69,771,293 | 4.95% |
| CHD | 40-110 | 8377972 | | 55,372,262 | 3.93% |
| CHD | 40-133 | 8255952 | | 14,399,031 | 1.02% |
| | Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot) | | | 1,116,190,114 | 79.21% |
| D2SP | AMZSQ73 | 291201 | A1 | 55,399,927 | 3.93% |
| D2SP | MDLZU94 | 250504 | BBB | 53,471,848 | 3.80% |
| D2SP | AXPG27 | 240730 | BBB+ | 45,484,616 | 3.23% |
| D2SP | AMGNV00 | 250221 | BBB | 45,303,186 | 3.22% |
| D2SP | AZNL27 | 251116 | BBB+ | 45,078,788 | 3.20% |
| D2SP | ORCLU90 | 240708 | BBB | 44,857,007 | 3.18% |
| D2SP | BKN70 | 250424 | A | 44,739,304 | 3.18% |
| D2SP | RDSAB65 | 281113 | A+ | 44,471,045 | 3.16% |
| D2SP | VZR33 | 241101 | BBB+ | 44,107,208 | 3.13% |
| D2SP | PFET61 | 290315 | A | 44,078,866 | 3.13% |
| D2SP | CMCSH26 | 280501 | A- | 44,047,589 | 3.13% |
| D2SP | WMRN95 | 290708 | AA | 44,007,310 | 3.12% |
| D2SP | PMJ63 | 290815 | A- | 43,211,623 | 3.07% |
| D2SP | HONE43 | 270301 | A | 41,914,270 | 2.97% |
| D2SP | UNHP53 | 250715 | A+ | 41,516,597 | 2.95% |
| D2SP | CMCSN03 | 250815 | A- | 40,199,436 | 2.85% |
| D2SP | DEU09 | 240910 | A | 36,520,924 | 2.59% |
| D2SP | CRMF13 | 280411 | A+ | 35,843,759 | 2.54% |
| D2SP | WFCW34 | 260422 | BBB+ | 35,495,989 | 2.52% |
| D2SP | SUMIF77 | 260714 | A- | 35,277,858 | 2.50% |
| D2SP | LOWM66 | 260415 | BBB+ | 35,232,876 | 2.50% |
| D2SP | PYPLD58 | 261001 | A- | 35,089,681 | 2.49% |
| D2SP | KOE82 | 270525 | A+ | 35,058,918 | 2.49% |
| D2SP | PEPN57 | 261006 | A-1 | 34,989,099 | 2.48% |
| D2SP | HDH36 | 280915 | A | 32,472,253 | 2.30% |
| D2SP | MSFTY93 | 270206 | AAA | 26,999,617 | 1.92% |
| D2SP | AAPLR93 | 270511 | AA+ | 26,583,600 | 1.89% |
| D2SP | TG64 | 280201 | BBB | 24,736,919 | 1.76% |

| | | | | | |
|------|---|--------|----------|----------------------|----------------|
| | Treasury Bonds (Tipo de Cambio Spot) | | | 103,624,175 | 7.35% |
| D6SP | TBONE01 | 440215 | AA+ | 103,624,175 | 7.35% |
| | Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot) | | | 79,159,817 | 5.62% |
| D5SP | TNOTZ59 | 340215 | AA+ | 54,805,659 | 3.89% |
| D5SP | TNOTS30 | 291115 | AA+ | 24,354,158 | 1.73% |
| | Títulos Emisoras Extranjeras SPOT | | | 35,000,538 | 2.48% |
| D8SP | MS | 1-19 | A- | 35,000,538 | 2.48% |
| | Reportos | | | 5,379,776 | 0.38% |
| LD | BONDESD | 250619 | AAA(mex) | 5,379,776 | 0.38% |
| | TOTAL CARTERA | | | 1,409,125,713 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 1,409,285,523 | |

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.067 %
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 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."