

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				371,214,943	15.02%
CHD	40-110	8377972		361,815,689	14.64%
CHD	40-133	8255952		9,399,255	0.38%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				1,173,552,947	47.49%
D2SP	AMZNQ73	291201	A1	61,755,482	2.50%
D2SP	MDLZU94	250504	BBB	59,447,249	2.41%
D2SP	AZNL27	251116	BBB+	50,297,330	2.04%
D2SP	AMGNV00	250221	BBB	49,747,915	2.01%
D2SP	RDSAB65	281113	A+	49,729,517	2.01%
D2SP	BKN70	250424	A	49,343,848	2.00%
D2SP	CMCSH26	280501	A-	49,163,867	1.99%
D2SP	VZR33	241101	BBB+	48,863,976	1.98%
D2SP	WMRN95	290708	AA	48,515,011	1.96%
D2SP	PFET61	290315	A	48,199,970	1.95%
D2SP	PMJ63	290815	A-	47,569,891	1.93%
D2SP	HONE43	270301	A	46,546,256	1.88%
D2SP	UNHP53	250715	A+	45,310,116	1.83%
D2SP	CMCSN03	250815	A-	43,941,178	1.78%
D2SP	ORCLT19	250401	BBB	39,724,435	1.61%
D2SP	AAPLY53	260223	AA+	39,684,212	1.61%
D2SP	CRMF13	280411	A+	39,247,150	1.59%
D2SP	KOE82	270525	A+	39,222,115	1.59%
D2SP	WFCW34	260422	BBB+	39,106,547	1.58%
D2SP	SUMIF77	260714	A-	39,023,763	1.58%
D2SP	LOWM66	260415	BBB+	38,986,950	1.58%
D2SP	PYPLD58	261001	A-	38,776,243	1.57%
D2SP	PEPN57	261006	A-1	38,685,164	1.57%
D2SP	HDH36	280915	A	35,938,130	1.45%
D2SP	AAPLR93	270511	AA+	29,682,924	1.20%
D2SP	MSFTY93	270206	AAA	29,652,489	1.20%
D2SP	TG64	280201	BBB	27,391,218	1.11%
Treasury Bonds (Tipo de Cambio Spot)				111,495,406	4.51%

D6SP	TBONE01	440215	AA+	111,495,406	4.51%
	Treasury Notes (Tipo de Cambio Spot)			814,631,913	32.97%
D5SP	TNOTB05	290815	AA+	233,082,634	9.43%
D5SP	TNOTZ59	340215	AA+	197,740,863	8.00%
D5SP	TNOTB28	270731	AA+	194,402,087	7.87%
D5SP	TNOTS30	291115	AA+	189,406,329	7.67%
	Reportos			127,238	0.01%
LG	BONDESG	260319	AAA(mex)	127,238	0.01%
	TOTAL CARTERA			2,471,022,447	100.00%
	ACTIVO NETO			2,466,173,489	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 2.728 % Var Promedio: 1.336 %
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."