

CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Chequera Dolares				5,940,127,153	43.12%
CHD	40-110	9730399		5,918,143,525	42.96%
CHD	40-133	8009722		21,983,628	0.16%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				305,603,167	2.22%
D2SP	SANTN90	240524	A	102,138,270	0.74%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	82,351,189	0.60%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	54,185,145	0.39%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,389,555	0.37%
D2SP	DEU09	240910	A	16,539,009	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,323,215	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,323,215	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)				49,162,180	0.36%
D7SP	ARBA944	260812	A+	40,766,897	0.30%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,395,283	0.06%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				5,908,990,498	42.89%
D4SP	TBILH58	240516	AA+	2,097,202,919	15.22%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,497,443,873	10.87%
D4SP	TBILE62	240611	AA+	835,634,545	6.07%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	662,114,834	4.81%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	328,722,309	2.39%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	241,018,438	1.75%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	166,210,502	1.21%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	80,643,078	0.59%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,389,732,366	10.09%
1ISP	SHV	*	Alta	633,822,447	4.60%
1ISP	IB01	N	Alta	370,209,660	2.69%
1ISP	AFLT	N	Alta	265,270,436	1.93%
1ISP	FLOT	*	Alta	120,429,824	0.87%

	Reportos			18,641,519	0.14%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	18,641,519	0.14%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			163,024,414	1.18%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	163,024,414	1.18%
	TOTAL CARTERA			13,776,604,512	100.00%
	ACTIVO NETO			13,827,201,004	

Cartera al: 09/05/2024

Límite Máximo de VaR: 1.492 % **Var Promedio:** 0.978 %
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."