

## CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>9,381,295,456</b>	<b>64.09%</b>
CHD	40-110	9730399		9,365,031,869	63.98%
CHD	40-133	8009722		16,263,587	0.11%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>170,841,743</b>	<b>1.17%</b>
D2SP	KCMAE93	250312	A-	59,848,344	0.41%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	55,786,727	0.38%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	36,946,210	0.25%
D2SP	DEU09	240910	A	18,260,462	0.13%
<b>Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)</b>				<b>1,450,567</b>	<b>0.01%</b>
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,450,567	0.01%
<b>Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)</b>				<b>54,212,016</b>	<b>0.37%</b>
D7SP	ARBA944	260812	A+	44,690,498	0.31%
D7SP	ARBA304	240630	A+	9,521,518	0.07%
<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>3,286,316,152</b>	<b>22.45%</b>
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,653,606,867	11.30%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	731,155,925	5.00%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	362,956,590	2.48%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	266,036,824	1.82%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	183,545,623	1.25%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	89,014,323	0.61%
<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>				<b>1,530,809,400</b>	<b>10.46%</b>
I1SP	SHV	*	Alta	696,464,027	4.76%
I1SP	IB01	N	Alta	408,675,360	2.79%
I1SP	AFLT	N	Alta	293,312,662	2.00%
I1SP	FLOT	*	Alta	132,357,352	0.90%
<b>Reportos</b>				<b>31,713,611</b>	<b>0.22%</b>
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	31,713,611	0.22%

	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)</b>			<b>180,196,729</b>	<b>1.23%</b>
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	180,196,729	1.23%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>14,636,835,674</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>14,711,309,557</b>	

**Cartera al: 27/06/2024**

**Límite Máximo de VaR: 1.523 % Var Promedio: 0.974 %**  
**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."**