

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			9,236,464,489	56.36%
CHD	40-110	9730399		9,219,055,520	56.26%
CHD	40-133	8009722		17,408,969	0.11%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio :			122,228,771	0.75%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	62,697,459	0.38%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	59,531,312	0.36%
	Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.M			1,519,444	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,519,444	0.01%
	Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero			46,812,523	0.29%
D7SP	ARBA944	260812	A+	46,812,523	0.29%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			5,172,877,275	31.57%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	1,155,032,019	7.05%
D4SP	TBILJ41	240924	AA+	963,641,321	5.88%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	955,380,450	5.83%
D4SP	TBILU05	241017	AA+	576,424,405	3.52%
D4SP	TBILV87	241024	AA+	575,886,649	3.51%
D4SP	TBILK05	250213	AA+	378,638,816	2.31%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	282,865,013	1.73%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	190,419,600	1.16%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	94,589,003	0.58%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			1,613,873,158	9.85%
11SP	SHV	*	Alta	729,732,190	4.45%
11SP	IB01	N	Alta	434,096,645	2.65%
11SP	AFLT	N	Alta	311,727,926	1.90%
11SP	FLOT	*	Alta	138,316,398	0.84%
	Reportos			957,125	0.01%
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	957,125	0.01%

	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (S			192,699,432	1.18%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	192,699,432	1.18%
	TOTAL CARTERA			16,387,432,217	100.00%
	ACTIVO NETO			16,561,484,811	

Cartera al: 19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 1.545 % Var Promedio: 1.094 %

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."