

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				9,288,259,775	64.05%
CHD	40-110	9730399		9,281,660,322	64.01%
CHD	40-133	8009722		6,599,453	0.05%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				170,075,842	1.17%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	59,661,140	0.41%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	55,394,975	0.38%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	36,813,609	0.25%
D2SP	DEU09	240910	A	18,206,118	0.13%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,447,557	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,447,557	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Sp				54,053,212	0.37%
D7SP	ARBA944	260812	A+	44,597,762	0.31%
D7SP	ARBA304	240630	A+	9,455,450	0.07%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				3,276,142,377	22.59%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,648,515,608	11.37%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	728,895,249	5.03%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	361,821,933	2.50%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	265,188,139	1.83%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	182,980,439	1.26%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	88,741,010	0.61%
Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot				1,525,892,020	10.52%
1ISP	SHV	*	Alta	694,326,611	4.79%
1ISP	IB01	N	Alta	407,459,908	2.81%
1ISP	AFLT	N	Alta	292,203,774	2.02%
1ISP	FLOT	*	Alta	131,901,727	0.91%
Reportos				5,280,812	0.04%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	5,280,812	0.04%

	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			179,589,455	1.24%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	179,589,455	1.24%
	TOTAL CARTERA			14,500,741,050	100.00%
	ACTIVO NETO			14,448,488,729	

Cartera al: 20/06/2024

Límite Máximo de VaR: 1.492 % Var Promedio: 0.963 %
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."