

## 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>9,040,577,751</b>	<b>62.25%</b>
CHD	40-110	9730399		8,974,918,715	61.80%
CHD	40-133	8009722		65,659,036	0.45%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>131,517,929</b>	<b>0.91%</b>
D2SP	KCMAE93	250312	A-	58,744,135	0.40%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	54,883,476	0.38%
D2SP	DEU09	240910	A	17,890,319	0.12%
	<b>Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)</b>			<b>1,416,684</b>	<b>0.01%</b>
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,416,684	0.01%
	<b>Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)</b>			<b>43,646,600</b>	<b>0.30%</b>
D7SP	ARBA944	260812	A+	43,646,600	0.30%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>3,564,535,394</b>	<b>24.54%</b>
D4SP	TBILB24	240815	AA+	1,432,579,406	9.86%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	1,066,707,162	7.35%
D4SP	TBILK78	240808	AA+	717,026,410	4.94%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	260,979,214	1.80%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	87,243,202	0.60%
	<b>Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>1,496,422,011</b>	<b>10.30%</b>
1ISP	SHV	*	Alta	679,456,737	4.68%
1ISP	IB01	N	Alta	400,495,749	2.76%
1ISP	AFLT	N	Alta	287,482,145	1.98%
1ISP	FLOT	*	Alta	128,987,380	0.89%
	<b>Reportos</b>			<b>67,685,575</b>	<b>0.47%</b>
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	67,685,575	0.47%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)</b>			<b>177,277,534</b>	<b>1.22%</b>
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	177,277,534	1.22%

<b>TOTAL CARTERA</b>	<b>14,523,079,478</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>	<b>14,483,405,775</b>	

**Cartera al:**                   **18/07/2024**

---

**Límite Máximo de VaR:       1.523 % Var Promedio:   1.013 %**  
**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."**

---