

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			7,746,000,945	49.30%
CHD	40-110	9730399		7,674,461,715	48.85%
CHD	40-133	8009722		71,539,230	0.46%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			145,204,188	0.92%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	64,889,662	0.41%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	60,574,822	0.39%
D2SP	DEU09	240910	A	19,739,704	0.13%
	Oper. Instrum. Fin. Derivados (Excedente Aport. Inic. Mín)			1,552,524	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,552,524	0.01%
	Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit. Extranjero (Spot)			47,831,660	0.30%
D7SP	ARBA944	260812	A+	47,831,660	0.30%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			5,859,580,452	37.30%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	1,176,838,677	7.49%
D4SP	TBILJ41	240924	AA+	981,972,500	6.25%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	972,967,292	6.19%
D4SP	TBILH84	240917	AA+	589,778,086	3.75%
D4SP	TBILU05	241017	AA+	587,265,247	3.74%
D4SP	TBILV87	241024	AA+	586,665,170	3.73%
D4SP	TBILK05	250213	AA+	385,494,568	2.45%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	288,393,805	1.84%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	193,923,417	1.23%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	96,281,690	0.61%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,646,832,221	10.48%
1ISP	SHV	*	Alta	746,428,755	4.75%
1ISP	IB01	N	Alta	441,892,156	2.81%
1ISP	AFLT	N	Alta	316,906,408	2.02%
1ISP	FLOT	*	Alta	141,604,903	0.90%
	Reportos			68,595,592	0.44%

IS	BPA182	300328	AAA(mex)	68,595,592	0.44%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			195,169,449	1.24%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	195,169,449	1.24%
	TOTAL CARTERA			15,710,767,031	100.00%
	ACTIVO NETO			15,696,933,909	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 1.545 % Var Promedio: 1.002 %
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."