

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				5,901,452,123	42.47%
CHD	40-110	9730399		5,901,236,647	42.47%
CHD	40-133	8009722		215,477	0.00%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				311,697,834	2.24%
D2SP	SANTN90	240524	A	104,037,388	0.75%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	84,876,739	0.61%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	55,137,290	0.40%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,801,854	0.37%
D2SP	DEU09	240910	A	16,844,564	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,349,549	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,349,549	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Sp				50,091,242	0.36%
D7SP	ARBA944	260812	A+	41,578,223	0.30%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,513,019	0.06%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				6,019,182,024	43.31%
D4SP	TBILH58	240516	AA+	2,136,395,983	15.37%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,525,404,159	10.98%
D4SP	TBILE62	240611	AA+	851,235,426	6.13%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	674,490,097	4.85%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	334,834,270	2.41%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	245,398,262	1.77%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	169,311,724	1.22%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	82,112,103	0.59%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot				1,418,563,097	10.21%
1ISP	SHV	*	Alta	648,079,181	4.66%
1ISP	IB01	N	Alta	376,995,122	2.71%
1ISP	AFLT	N	Alta	270,324,786	1.95%
1ISP	FLOT	*	Alta	123,164,008	0.89%

	Reportos			28,743,695	0.21%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	28,743,695	0.21%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			165,451,196	1.19%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	165,451,196	1.19%
	TOTAL CARTERA			13,896,530,760	100.00%
	ACTIVO NETO			13,942,132,252	

Cartera al: 30/04/2024

Límite Máximo de VaR: 1.492 % **Var Promedio:** 0.950 %
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."