

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				8,770,703,546	60.04%
CHD	40-110	9730399		8,754,798,423	59.93%
CHD	40-133	8009722		15,905,122	0.11%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				156,012,722	1.07%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	54,932,781	0.38%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,942,432	0.35%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	33,370,730	0.23%
D2SP	DEU09	240910	A	16,766,779	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,337,052	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,337,052	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)				49,816,825	0.34%
D7SP	ARBA944	260812	A+	41,193,197	0.28%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,623,629	0.06%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				3,865,150,201	26.46%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,518,501,759	10.40%
D4SP	TBILE62	240611	AA+	847,402,539	5.80%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	671,395,287	4.60%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	333,287,430	2.28%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	244,282,412	1.67%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	168,548,932	1.15%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	81,731,843	0.56%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,408,960,943	9.65%
1ISP	SHV	*	Alta	642,310,236	4.40%
1ISP	IB01	N	Alta	375,268,711	2.57%
1ISP	AFLT	N	Alta	269,239,132	1.84%
1ISP	FLOT	*	Alta	122,142,864	0.84%
Reportos				191,394,557	1.31%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	191,394,557	1.31%

	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			164,896,456	1.13%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	164,896,456	1.13%
	TOTAL CARTERA			14,608,272,302	100.00%
	ACTIVO NETO			14,579,907,726	

Cartera al: 31/05/2024

Límite Máximo de VaR: 1.439 % Var Promedio: 0.946 %
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."