

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				9,374,476,419	64.22%
CHD	40-110	9730399		9,361,342,799	64.13%
CHD	40-133	8009722		13,133,620	0.09%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				169,864,044	1.16%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	59,512,835	0.41%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	55,498,960	0.38%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	36,705,827	0.25%
D2SP	DEU09	240910	A	18,146,422	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,440,907	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,440,907	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)				53,864,140	0.37%
D7SP	ARBA944	260812	A+	44,392,865	0.30%
D7SP	ARBA304	240630	A+	9,471,275	0.07%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				3,265,854,937	22.37%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,643,325,422	11.26%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	726,600,665	4.98%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	360,689,140	2.47%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	264,380,040	1.81%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	182,401,870	1.25%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	88,457,801	0.61%
Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,521,231,348	10.42%
1ISP	SHV	*	Alta	692,138,860	4.74%
1ISP	IB01	N	Alta	406,026,785	2.78%
1ISP	AFLT	N	Alta	291,589,833	2.00%
1ISP	FLOT	*	Alta	131,475,871	0.90%
Reportos				31,539,656	0.22%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	31,539,656	0.22%

	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			179,024,359	1.23%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	179,024,359	1.23%
	TOTAL CARTERA			14,597,295,810	100.00%
	ACTIVO NETO			14,623,194,059	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 1.523 % Var Promedio: 0.975 %
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."