

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				5,880,403,575	35.42%
CHD	40-110	9730399		5,867,113,076	35.34%
CHD	40-133	8009722		13,290,499	0.08%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				125,112,719	0.75%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	64,998,698	0.39%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	60,114,021	0.36%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,565,470	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,565,470	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)				48,230,526	0.29%
D7SP	ARBA944	260812	A+	48,230,526	0.29%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				8,684,424,462	52.31%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	1,981,419,034	11.93%
D4SP	TBILB06	241112	AA+	992,846,163	5.98%
D4SP	TBILE45	241203	AA+	990,208,839	5.96%
D4SP	TBILN44	241210	AA+	989,328,482	5.96%
D4SP	TBILP91	241217	AA+	988,445,672	5.95%
D4SP	TBILZ82	250130	AA+	983,129,631	5.92%
D4SP	TBILJ32	250206	AA+	392,890,515	2.37%
D4SP	TBILK05	250213	AA+	392,582,056	2.37%
D4SP	TBILG92	250807	AA+	384,851,151	2.32%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	293,199,461	1.77%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	197,465,200	1.19%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	98,058,259	0.59%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,665,200,321	10.03%
1ISP	SHV	*		749,931,120	4.52%
1ISP	IB01	N		449,788,880	2.71%
1ISP	AFLT	N		323,169,880	1.95%
1ISP	FLOT	*		142,310,440	0.86%

	Reportos			46,232	0.00%
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	46,232	0.00%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			198,212,439	1.19%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	198,212,439	1.19%
	TOTAL CARTERA			16,603,195,744	100.00%
	ACTIVO NETO			15,660,500,850	

Cartera al: 07/11/2024

Límite Máximo de VaR: 1.562 % **Var Promedio:** 1.209 %
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."