

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				6,868,757,127	52.45%
CHD	40-110	9730399		6,864,184,418	52.41%
CHD	40-133	8009722		4,572,709	0.04%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				299,415,738	2.29%
D2SP	SANTN90	240524	A	99,505,126	0.76%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	80,821,995	0.62%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	52,737,588	0.40%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,223,211	0.38%
D2SP	DEU09	240910	A	16,127,818	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,295,116	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,295,116	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)				47,952,461	0.37%
D7SP	ARBA944	260812	A+	39,901,190	0.31%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,051,270	0.06%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				4,302,147,817	32.85%
D4SP	TBILH58	240516	AA+	1,226,467,025	9.37%
D4SP	TBILN80	240416	AA+	821,309,986	6.27%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	648,681,183	4.95%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	645,445,474	4.93%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	320,396,369	2.45%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	235,000,195	1.79%
D4SP	TBILX52	240418	AA+	164,213,013	1.25%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	162,027,386	1.24%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	78,607,186	0.60%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,357,491,834	10.37%
1ISP	SHV	*	Alta	620,588,080	4.74%
1ISP	IB01	N	Alta	360,868,816	2.76%
1ISP	AFLT	N	Alta	258,231,899	1.97%
1ISP	FLOT	*	Alta	117,803,040	0.90%

	Reportos			61,155,666	0.47%
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	61,155,666	0.47%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			158,558,295	1.21%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	158,558,295	1.21%
	TOTAL CARTERA			13,096,774,054	100.00%
	ACTIVO NETO			13,097,880,118	

Cartera al: 11/04/2024

Límite Máximo de VaR: 1.453 % Var Promedio: 0.944 %
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."