

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			7,352,256,551	42.28%
CHD	40-110	9730399		7,337,703,017	42.20%
CHD	40-133	8009722		14,553,534	0.08%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)			125,699,635	0.72%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	65,300,160	0.38%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	60,399,475	0.35%
	Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)			1,576,809	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,576,809	0.01%
	Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)			48,579,868	0.28%
D7SP	ARBA944	260812	A+	48,579,868	0.28%
	Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)			7,966,856,150	45.82%
D4SP	TBILP56	241129	AA+	1,993,793,826	11.47%
D4SP	TBILA23	241105	AA+	1,000,017,763	5.75%
D4SP	TBILB06	241112	AA+	999,095,851	5.75%
D4SP	TBILE45	241203	AA+	996,407,036	5.73%
D4SP	TBILN44	241210	AA+	995,516,071	5.73%
D4SP	TBILP91	241217	AA+	994,612,459	5.72%
D4SP	TBILK05	250213	AA+	395,023,354	2.27%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	295,033,868	1.70%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	198,690,185	1.14%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	98,665,739	0.57%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			1,679,456,997	9.66%
1ISP	SHV	*		757,864,880	4.36%
1ISP	IB01	N		452,406,427	2.60%
1ISP	AFLT	N		325,478,375	1.87%
1ISP	FLOT	*		143,707,316	0.83%
	Reportos			15,012,634	0.09%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	15,012,634	0.09%

	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			199,549,522	1.15%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	199,549,522	1.15%
	TOTAL CARTERA			17,388,988,166	100.00%
	ACTIVO NETO			17,471,272,391	

Cartera al: 31/10/2024

Límite Máximo de VaR: 1.715 % Var Promedio: 1.232 %
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."