

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				5,613,713,639	41.15%
CHD	40-110	9730399		5,611,121,586	41.13%
CHD	40-133	8009722		2,592,053	0.02%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				308,953,944	2.27%
D2SP	SANTN90	240524	A	103,413,807	0.76%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	83,727,900	0.61%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	54,744,067	0.40%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,317,496	0.37%
D2SP	DEU09	240910	A	16,750,674	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,344,017	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,344,017	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Sp				49,806,073	0.37%
D7SP	ARBA944	260812	A+	41,407,801	0.30%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,398,272	0.06%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				5,983,166,342	43.86%
D4SP	TBILH58	240516	AA+	2,123,506,639	15.57%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,516,217,087	11.11%
D4SP	TBILE62	240611	AA+	846,098,528	6.20%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	670,469,218	4.92%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	332,860,245	2.44%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	244,076,994	1.79%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	168,289,879	1.23%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	81,647,754	0.60%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot				1,410,329,122	10.34%
1ISP	SHV	*	Alta	644,604,856	4.73%
1ISP	IB01	N	Alta	374,835,842	2.75%
1ISP	AFLT	N	Alta	268,421,276	1.97%
1ISP	FLOT	*	Alta	122,467,149	0.90%

	Reportos			110,280,018	0.81%
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	110,280,018	0.81%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			164,504,544	1.21%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	164,504,544	1.21%
	TOTAL CARTERA			13,642,097,699	100.00%
	ACTIVO NETO			13,721,935,678	

Cartera al: 18/04/2024

Límite Máximo de VaR: 1.453 % **Var Promedio:** 0.943 %
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."