

## CORTO PLAZO ESPECIALIZADO EN DÓLARES

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
<b>Chequera Dolares</b>				<b>5,862,701,957</b>	<b>42.50%</b>
CHD	40-110	9730399		5,847,599,747	42.39%
CHD	40-133	8009722		15,102,209	0.11%
<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>308,587,467</b>	<b>2.24%</b>
D2SP	SANTN90	240524	A	103,270,143	0.75%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	83,324,014	0.60%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	54,747,143	0.40%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,525,792	0.37%
D2SP	DEU09	240910	A	16,720,375	0.12%
<b>Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)</b>				<b>1,339,100</b>	<b>0.01%</b>
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,339,100	0.01%
<b>Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Sp</b>				<b>49,709,545</b>	<b>0.36%</b>
D7SP	ARBA944	260812	A+	41,256,315	0.30%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,453,230	0.06%
<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>				<b>5,973,686,000</b>	<b>43.31%</b>
D4SP	TBILH58	240516	AA+	2,120,188,851	15.37%
D4SP	TBILB79	240711	AA+	1,513,858,894	10.98%
D4SP	TBILE62	240611	AA+	844,778,113	6.12%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	669,368,392	4.85%
D4SP	TBILW17	241003	AA+	332,312,506	2.41%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	243,633,890	1.77%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	168,028,953	1.22%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	81,516,400	0.59%
<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot</b>				<b>1,405,039,612</b>	<b>10.19%</b>
1ISP	SHV	*	Alta	640,849,554	4.65%
1ISP	IB01	N	Alta	374,246,272	2.71%
1ISP	AFLT	N	Alta	268,259,494	1.95%
1ISP	FLOT	*	Alta	121,684,291	0.88%

	<b>Reportos</b>			<b>28,660,429</b>	<b>0.21%</b>
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	28,660,429	0.21%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)</b>			<b>164,574,379</b>	<b>1.19%</b>
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	164,574,379	1.19%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>13,794,298,489</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>13,822,341,449</b>	

**Cartera al:** 02/05/2024

**Límite Máximo de VaR:** 1.492 % **Var Promedio:** 0.979 %  
**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."