

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				7,825,366,334	59.72%
CHD	40-110	9730399		7,824,058,252	59.71%
CHD	40-133	8009722		1,308,082	0.01%
Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)				301,779,982	2.30%
D2SP	SANTN90	240524	A	100,136,913	0.76%
D2SP	SIGME93	260502	BBB	81,546,625	0.62%
D2SP	KCMAE93	250312	A-	53,190,240	0.41%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	50,689,171	0.39%
D2SP	DEU09	240910	A	16,217,032	0.12%
Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)				1,305,084	0.01%
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,305,084	0.01%
Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)				48,792,748	0.37%
D7SP	ARBA944	260812	A+	40,208,290	0.31%
D7SP	ARBA304	240630	A+	8,584,458	0.07%
Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)				3,117,187,634	23.79%
D4SP	TBILH58	240516	AA+	1,233,911,053	9.42%
D4SP	TBILN80	240416	AA+	826,277,586	6.31%
D4SP	TBILB24	240815	AA+	649,550,987	4.96%
D4SP	TBILX52	240418	AA+	165,206,921	1.26%
D4SP	TBILS77	240718	AA+	163,020,262	1.24%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	79,220,826	0.61%
Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				1,369,302,165	10.45%
1ISP	SHV	*	Alta	627,066,429	4.79%
1ISP	IB01	N	Alta	363,116,250	2.77%
1ISP	AFLT	N	Alta	260,060,146	1.99%
1ISP	FLOT	*	Alta	119,059,339	0.91%
Títulos Emisoras Extranjeras SPOT				208,111,945	1.59%
D8SP	KIMBER2	1-22	A-	208,111,945	1.59%

	Reportos			70,849,674	0.54%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	70,849,674	0.54%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)			160,420,457	1.22%
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	160,420,457	1.22%
	TOTAL CARTERA			13,103,116,023	100.00%
	ACTIVO NETO			13,149,986,226	
	Cartera al:	27/03/2024			

Límite Máximo de VaR: 1.453 % Var Promedio: 1.037 %
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."