

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
**HR Ratings de México, S.A.
De C.V.**
Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				1,564,202,053	26.73%
FSP	BACMEXT	D23012	F1+ (mex)	143,427,049	2.45%
FSP	BACMEXT	D24001	F1+ (mex)	144,300,126	2.47%
FSP	NAFIN	D23086	F1+ (mex)	143,969,847	2.46%
FSP	NAFIN	D23088	F1+ (mex)	143,829,765	2.46%
FSP	NAFIN	D23090	F1+ (mex)	143,727,816	2.46%
FSP	NAFIN	D23092	F1+ (mex)	143,564,682	2.45%
FSP	NAFIN	D24002	F1+ (mex)	144,483,354	2.47%
FSP	NAFIN	D24004	F1+ (mex)	144,347,948	2.47%
FSP	NAFIN	D24006	F1+ (mex)	268,499,468	4.59%
FSP	NAFIN	D24007	F1+ (mex)	144,051,995	2.46%
Track de Deuda Corporativa				41,605,000	0.71%
1C	DLRTRAC	15	N/A	41,605,000	0.71%
Chequera Dolares				3,685,581,374	62.97%
CHD	37-006	4006562	N/A	1,021,433,590	17.45%
CHD	37-135	6009236	N/A	1,021,496,372	17.45%
CHD	40-002	9409199	N/A	258,158	0.00%
CHD	40-012	6539459	N/A	844,369,382	14.43%
CHD	40-044	0941285	N/A	798,023,872	13.64%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				561,131,142	9.59%
1ISP	IB01	N	N/A	561,131,142	9.59%
TOTAL CARTERA				5,852,519,569	100.00%
ACTIVO NETO				5,848,764,335	
Cartera al:		25/Ene/2024			

Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.0440%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV