

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)				1,536,572,222	29.39%
FSP	BACMEXT	D23011	F1+ (mex)	141,745,784	2.71%
FSP	BACMEXT	D23012	F1+ (mex)	140,888,781	2.69%
FSP	NAFIN	D23079	F1+ (mex)	141,930,185	2.71%
FSP	NAFIN	D23081	F1+ (mex)	141,796,798	2.71%
FSP	NAFIN	D23084	F1+ (mex)	141,504,107	2.71%
FSP	NAFIN	D23086	F1+ (mex)	141,423,321	2.71%
FSP	NAFIN	D23088	F1+ (mex)	141,286,107	2.70%
FSP	NAFIN	D23090	F1+ (mex)	141,190,054	2.70%
FSP	NAFIN	D23092	F1+ (mex)	141,030,159	2.70%
FSP	NAFIN	D23093	F1+ (mex)	263,776,927	5.05%
Track de Deuda Corporativa				40,800,000	0.78%
1C	DLRTRAC	15	N/A	40,800,000	0.78%
Chequera Dolares				3,100,414,399	59.30%
CHD	37-006	4006562	N/A	834,072,254	15.95%
CHD	37-135	6009236	N/A	834,090,095	15.95%
CHD	40-002	9409199	N/A	254,499	0.01%
CHD	40-012	6539459	N/A	647,557,893	12.38%
CHD	40-044	0941285	N/A	784,439,658	15.00%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				551,041,235	10.54%
1ISP	IB01	N	N/A	551,041,235	10.54%
TOTAL CARTERA				5,228,827,856	100.00%
ACTIVO NETO				5,225,307,424	

 Cartera al: **29/Dic/2023**
Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.0460%

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