

## 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>5,721,110,714</b>	<b>36.10%</b>
CHD	40-110	9730399		5,710,155,098	36.03%
CHD	40-133	8009722		10,955,616	0.07%
	<b>Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>128,506,954</b>	<b>0.81%</b>
D2SP	KCMAE93	250312	A-	66,818,574	0.42%
D2SP	PEMEX31	251016	BBB	61,688,380	0.39%
	<b>Oper.Instrum.Fin.Derivados (Excedente Aport.Inic.Mín)</b>			<b>1,609,526</b>	<b>0.01%</b>
EAIM	RJOBRIE	9510018		1,609,526	0.01%
	<b>Notas Estructuradas Mediano Plazo Emit.Extranjero (Spot)</b>			<b>49,587,837</b>	<b>0.31%</b>
D7SP	ARBA944	260812	A+	49,587,837	0.31%
	<b>Treasury Bills (Tipo de Cambio Spot)</b>			<b>7,915,036,124</b>	<b>49.94%</b>
D4SP	TBILP56	241129	AA+	2,038,987,063	12.86%
D4SP	TBILE45	241203	AA+	1,018,987,312	6.43%
D4SP	TBILN44	241210	AA+	1,018,078,259	6.42%
D4SP	TBILP91	241217	AA+	1,017,173,924	6.42%
D4SP	TBILZ82	250130	AA+	1,011,763,734	6.38%
D4SP	TBILJ32	250206	AA+	404,332,644	2.55%
D4SP	TBILK05	250213	AA+	403,977,254	2.55%
D4SP	TBILG92	250807	AA+	395,903,139	2.50%
D4SP	TBILJ59	250320	AA+	301,730,391	1.90%
D4SP	TBILV40	241226	AA+	203,193,254	1.28%
D4SP	TBILA41	250220	AA+	100,909,152	0.64%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>1,713,811,075</b>	<b>10.81%</b>
1ISP	SHV	*		771,630,510	4.87%
1ISP	IB01	N		462,692,017	2.92%
1ISP	AFLT	N		333,029,459	2.10%
1ISP	FLOT	*		146,459,089	0.92%
	<b>Reportos</b>			<b>116,371,081</b>	<b>0.73%</b>

IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	116,371,081	0.73%
	<b>Títulos de Organismos Financieros Multilaterales (Spot)</b>			<b>203,871,538</b>	<b>1.29%</b>
JISP	CABEG74	260209	AAA (mex)	203,871,538	1.29%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>15,849,904,849</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>16,005,752,263</b>	
<b>Cartera al:</b>		<b>14/11/2024</b>			

---

**Límite Máximo de VaR: 1.621 % Var Promedio: 1.172 %**  
**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."