LIQUIDO

AAA/1 MO

PRINCIPAL HORIZONTE C, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bondes D			**226,049,168**	**5.42%**
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	150,870,759	3.62 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	75,178,409	1.80 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			**456,244,242**	**10.93%**
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	203,085,866	4.87 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	133,179,215	3.19 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	119,979,161	2.88 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			**159,987,126**	**3.83%**
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	84,880,555	2.03 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	75,106,571	1.80 %
	Cetes			**1,085,376,662**	**26.01%**
BI	CETES	240613	AAA(mex)	430,938,970	10.33 %
BI	CETES	240516	AAA(mex)	405,343,756	9.71 %
BI	CETES	240530	AAA(mex)	148,139,925	3.55 %
BI	CETES	240620	AAA(mex)	100,954,011	2.42 %
	Reportos			**536,200,669**	**12.85%**
BI	CETES	240704	AAA(mex)	180,402,363	4.32 %
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	161,450,442	3.87 %
BI	CETES	240718	AAA(mex)	158,299,878	3.79 %
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	36,047,986	0.86 %
	Varios			**1,708,695,710**	**40.95%**
LF	BONDESF	240425	AAA(mex)	201,411,480	4.83 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	201,277,062	4.82 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	201,265,916	4.82 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	201,055,096	4.82 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	200,924,956	4.82 %
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	151,048,133	3.62 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	150,942,729	3.62 %
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	100,435,589	2.41 %
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,199,036	2.40 %
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	100,179,394	2.40 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	99,956,319	2.40 %
	TOTAL CARTERA			**4,172,553,576**	**100.00%**
	ACTIVO NETO			**4,168,136,101**	**-**
	VAR ESTABLECIDO $			**10,420,340**	**0.25%**
	VAR OBSERVADO PROMEDIO $			**1,724,804**	**0.04%**
	Cartera al:		4/18/2024		**-**

EL VALOR EN RIESGO (VAR POR SUS SIGLAS EN INGLÉS) ES CALCULADO UTILIZANDO EL MÉTODO MONTECARLO, CONSIDERANDO 250 PERÍODOS DE HISTORIA Y GENERANDO 1000 ESCENARIOS DE LOS PRINCIPALES FACTORES DE RIESGO QUE AFECTAN EL VALOR DE LOS

ACTIVOS QUE COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.