

**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	%
	<b>Bondes D</b>			<b>225,625,464</b>	<b>4.74%</b>
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	150,143,294	3.15 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	75,482,171	1.58 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>458,062,674</b>	<b>9.62%</b>
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	203,896,080	4.28 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	133,710,019	2.81 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	120,456,575	2.53 %
	<b>Bonos Prot.Ahorro pago mensual</b>			<b>160,634,364</b>	<b>3.37%</b>
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	85,225,930	1.79 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	75,408,434	1.58 %
	<b>Cetes</b>			<b>1,365,358,445</b>	<b>28.66%</b>
BI	CETES	240613	AAA(mex)	432,666,981	9.08 %
BI	CETES	240516	AAA(mex)	406,959,919	8.54 %
BI	CETES	240801	AAA(mex)	150,765,943	3.17 %
BI	CETES	240711	AAA(mex)	146,819,715	3.08 %
BI	CETES	240725	AAA(mex)	126,785,893	2.66 %
BI	CETES	240620	AAA(mex)	101,359,995	2.13 %
	<b>Reportos</b>			<b>900,148,602</b>	<b>18.90%</b>
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	860,528,327	18.07 %
BI	CETES	250123	AAA(mex)	39,620,274	0.83 %
	<b>Varios</b>			<b>1,653,604,127</b>	<b>34.71%</b>
LF	BONDES F	250130	AAA(mex)	200,303,292	4.21 %
LF	BONDES F	250227	AAA(mex)	200,296,678	4.20 %
LF	BONDES F	251009	AAA(mex)	200,098,388	4.20 %
LF	BONDES F	260226	AAA(mex)	200,002,364	4.20 %
LF	BONDES F	240523	AAA(mex)	150,313,236	3.16 %
LF	BONDES F	250327	AAA(mex)	150,222,953	3.15 %
LF	BONDES F	260423	AAA(mex)	149,962,373	3.15 %
LF	BONDES F	240725	AAA(mex)	100,841,522	2.12 %
LF	BONDES F	241024	AAA(mex)	100,604,749	2.11 %
LF	BONDES F	250116	AAA(mex)	100,584,637	2.11 %
LF	BONDES F	260604	AAA(mex)	100,373,936	2.11 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>4,763,433,676</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>4,456,986,535</b>	-
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>11,142,466</b>	<b>0.25%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>1,757,094</b>	<b>0.04%</b>
	<b>Cartera al:</b>		4/30/2024		-

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.