

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			225,202,764	5.21%
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	149,860,965	3.47 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	75,341,799	1.74 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			457,199,136	10.58%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	203,511,354	4.71 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	133,464,122	3.09 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	120,223,660	2.78 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			160,334,319	3.71%
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	85,066,116	1.97 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	75,268,202	1.74 %
	Cetes			1,214,258,833	28.09%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	431,881,031	9.99 %
BI	CETES	240516	AAA(mex)	406,207,461	9.40 %
BI	CETES	240530	AAA(mex)	148,451,445	3.43 %
BI	CETES	240725	AAA(mex)	126,543,125	2.93 %
BI	CETES	240620	AAA(mex)	101,175,770	2.34 %
	Reportos			764,194,820	17.68%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	715,218,184	16.55 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	48,976,636	1.13 %
	Varios			1,500,813,672	34.73%
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	199,927,066	4.63 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	199,926,844	4.63 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	199,723,684	4.62 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	199,608,776	4.62 %
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	150,035,667	3.47 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	149,945,918	3.47 %
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	100,652,382	2.33 %
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	100,415,388	2.32 %
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	100,395,702	2.32 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	100,182,245	2.32 %
	TOTAL CARTERA			4,322,003,543	100.00%
	ACTIVO NETO			4,315,866,885	-
	VAR ESTABLECIDO \$			10,789,667	0.25%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,734,436	0.04%
	Cartera al:		4/25/2024		-

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.