

**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>150,907,035</b>	<b>4.45%</b>
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	150,907,035	4.45 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>457,162,468</b>	<b>13.47%</b>
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	201,919,974	5.95 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	132,512,626	3.91 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	122,729,868	3.62 %
	<b>Bonos Prot.Ahorro pago mensual</b>			<b>105,099,808</b>	<b>3.10%</b>
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	75,127,059	2.21 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	29,972,749	0.88 %
	<b>Cetes</b>			<b>58,056,996</b>	<b>1.71%</b>
BI	CETES	240418	AAA(mex)	58,056,996	1.71 %
	<b>Reportos</b>			<b>1,454,950,901</b>	<b>42.88%</b>
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	641,042,884	18.89 %
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	500,634,354	14.75 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	153,301,503	4.52 %
BI	CETES	240530	AAA(mex)	85,917,503	2.53 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	74,054,657	2.18 %
	<b>Varios</b>			<b>1,167,086,385</b>	<b>34.39%</b>
LF	BONDESF	240425	AAA(mex)	201,560,260	5.94 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	201,330,010	5.93 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	201,316,450	5.93 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	201,102,168	5.93 %
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	151,155,527	4.45 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	150,970,026	4.45 %
LF	BONDESF	240111	AAA(mex)	59,651,944	1.76 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,393,263,593</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,388,851,232</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>8,472,128</b>	<b>0.25%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>1,588,837</b>	<b>0.06%</b>
	<b>Cartera al:</b>		12/29/2023		<b>-</b>

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.