

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	%
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			121,621,216	5.51%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	121,621,216	5.51 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			180,328,163	8.17%
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	85,029,793	3.85 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	75,210,284	3.41 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	20,088,086	0.91 %
	Cetes			1,076,558,766	48.80%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	280,891,953	12.73 %
BI	CETES	250130	AAA(mex)	196,727,500	8.92 %
BI	CETES	250430	AAA(mex)	177,576,801	8.05 %
BI	CETES	250109	AAA(mex)	158,308,912	7.18 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	98,173,160	4.45 %
BI	CETES	250306	AAA(mex)	68,192,705	3.09 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	48,521,080	2.20 %
BI	CETES	250416	AAA(mex)	48,166,655	2.18 %
	Reportos			125,249,133	5.68%
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	125,249,133	5.68 %
	Varios			702,469,624	31.84%
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	250,764,327	11.37 %
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	150,837,995	6.84 %
LF	BONDESF	260115	AAA(mex)	100,195,001	4.54 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	100,129,961	4.54 %
LF	BONDESF	250522	AAA(mex)	50,341,829	2.28 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	50,200,512	2.28 %
	TOTAL CARTERA			2,206,226,902	100.00%
	ACTIVO NETO			2,201,961,491	-
	VAR ESTABLECIDO \$			5,504,904	0.25%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			953,748	0.04%
	Cartera al:		11/29/2024		-

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.