

**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>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>122,256,544</b>	<b>4.57%</b>
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	122,256,544	4.57 %
	<b>Bonos Prot.Ahorro pago mensual</b>			<b>180,518,122</b>	<b>6.74%</b>
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	85,480,189	3.19 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	75,003,748	2.80 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	20,034,186	0.75 %
	<b>Cetes</b>			<b>746,318,549</b>	<b>27.87%</b>
BI	CETES	250430	AAA(mex)	178,520,098	6.67 %
BI	CETES	250123	AAA(mex)	133,737,561	4.99 %
BI	CETES	250130	AAA(mex)	98,873,940	3.69 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	98,683,560	3.69 %
BI	CETES	250626	AAA(mex)	95,126,660	3.55 %
BI	CETES	250306	AAA(mex)	68,550,650	2.56 %
BI	CETES	250416	AAA(mex)	48,426,910	1.81 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	24,399,170	0.91 %
	<b>Reportos</b>			<b>518,063,260</b>	<b>19.35%</b>
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	518,063,260	19.35 %
	<b>Varios</b>			<b>1,110,680,973</b>	<b>41.48%</b>
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	250,055,341	9.34 %
LF	BONDESF	251218	AAA(mex)	199,865,180	7.46 %
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	150,402,179	5.62 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	100,339,125	3.75 %
LF	BONDESF	260115	AAA(mex)	99,912,513	3.73 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	99,848,001	3.73 %
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	56,738,035	2.12 %
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	53,252,051	1.99 %
LF	BONDESF	250522	AAA(mex)	50,195,927	1.87 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	50,072,623	1.87 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,677,837,449</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,479,594,265</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>6,198,986</b>	<b>0.25%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>934,012</b>	<b>0.04%</b>
	<b>Cartera al:</b>		12/19/2024		<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.