

LIQUIDO

AAAf/S2(mex)

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	%
IS	BPAS 182 BPA182	180705	AAA(mex)	25,135,024 25,135,024	4.66 % 4.66 %
LD	Bondes D BONDESD	170824	AAA(mex)	70,066,844 70,066,844	12.98 % 12.98 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			176,792,794	32.76 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	70,580,720	13.08 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	50,513,174	9.36 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	40,519,730	7.51 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	15,179,171	2.81 %
	Renortos			267,682,575	49.60 %
LD	BONDESD	170824	AAA(mex)	117,653,025	21.80 %
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	81,779,987	15.15 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	68,249,563	12.65 %
	TOTAL CARTERA			539,677,237	100.00 %
	ACTIVO NETO			536,211,356	
	VAR ESTABLECIDO \$			1,340,528	0.25 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			40,059	0.00 %
	Cartera al:		7/31/2017		

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.