

## 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	%
BI	<b>Cetes</b> CETES	180301	AAA(mex)	<b>48,562,380</b> 48,562,380	<b>15.92 %</b> 15.92 %
S	<b>Reportos</b> UDIBONO	190613	AAA(mex)	<b>256,529,102</b> 256,529,102	<b>84.08 %</b> 84.08 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>305,091,482</b>	<b>100.00 %</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>255,700,573</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>639,251</b>	<b>0.25 %</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>102,682</b>	<b>0.04 %</b>
	<b>Cartera al:</b>		9/29/2017		

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.