

PRINFMP
AAA/2 MO
PRINCIPAL S, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			111,272,196	11.63%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	59,987,119	6.27 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	51,285,077	5.36 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			128,462,979	13.43%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	49,989,788	5.22 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	40,211,543	4.20 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,261,648	4.00 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			6,397,085	0.67%
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	6,397,085	0.67 %
	Certificado Bursatil			190,806,446	19.94%
91	VWLEASE	24	mxAAA	35,353,125	3.70 %
91	DAFCB	24	Aaa.mx	30,049,433	3.14 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	25,352,912	2.65 %
91	ENGENCB	24-2	AAA(mex)	20,134,510	2.10 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	19,632,765	2.05 %
91	AXO	19-2	A+(mex)	14,879,160	1.56 %
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	14,110,722	1.47 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,087,894	1.37 %
91	LALA	19-2	AA(mex)	12,749,356	1.33 %
91	ARA	23X	mxAA-	5,337,228	0.56 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			244,468,317	25.55%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	79,843,559	8.35 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	70,783,356	7.40 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	55,395,291	5.79 %
BI	CETES	240919	AAA(mex)	38,446,110	4.02 %
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			110,882,767	11.59%
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	50,560,414	5.28 %
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	50,274,738	5.25 %
D8	GSG1126	FLOAT	AAA(mex)	10,047,615	1.05 %
	Udibonos UDIS			35,072,241	3.67%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	35,072,241	3.67 %
	Reportos			129,420,041	13.53%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	129,420,041	13.53 %
	TOTAL CARTERA			956,782,070	100.00%
	ACTIVO NETO			992,052,993	-
	VAR ESTABLECIDO \$			2,678,543	0.27%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			720,025	0.08%
	Cartera al:		6/28/2024		-

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 7 DÍAS.