

PRINFGU
AAA/1 MO
PRINCIPAL INSTITUCIONAL, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bondes D			1,736,866,794	7.22%
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	980,868,632	4.07 %
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	352,116,415	1.46 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	302,394,720	1.26 %
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	101,487,027	0.42 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			2,513,865,124	10.44%
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	1,702,277,576	7.07 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	710,038,938	2.95 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	101,548,609	0.42 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			4,150,592,563	17.24%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	783,324,802	3.25 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	601,818,636	2.50 %
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	588,408,023	2.44 %
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	502,681,215	2.09 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	500,387,070	2.08 %
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	401,024,924	1.67 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	369,663,907	1.54 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	299,947,275	1.25 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	103,336,711	0.43 %
	Cetes			1,627,774,337	6.76%
BI	CETES	240418	AAA(mex)	587,441,973	2.44 %
BI	CETES	240502	AAA(mex)	424,890,976	1.77 %
BI	CETES	240404	AAA(mex)	328,585,711	1.37 %
BI	CETES	240125	AAA(mex)	218,021,657	0.91 %
BI	CETES	240822	AAA(mex)	68,834,020	0.29 %
	Reportos			8,808,364,389	36.59%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	1,530,177,110	6.36 %
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	1,501,903,321	6.24 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,500,875,896	6.24 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	1,281,986,776	5.33 %
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	1,186,676,379	4.93 %
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	1,108,658,476	4.61 %
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	400,507,463	1.66 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	297,578,967	1.24 %
	Varios			5,233,853,093	21.74%
LF	BONDESF	240104	AAA(mex)	856,937,607	3.56 %
LF	BONDESF	240321	AAA(mex)	801,054,296	3.33 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	704,655,035	2.93 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	502,597,445	2.09 %
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	489,475,288	2.03 %
LF	BONDESF	240111	AAA(mex)	402,373,992	1.67 %
LF	BONDESF	250102	AAA(mex)	302,031,306	1.25 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	300,813,744	1.25 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	271,746,047	1.13 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	201,102,168	0.84 %
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	200,564,204	0.83 %
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	200,501,961	0.83 %
	TOTAL CARTERA			24,071,316,299	100.00%
	ACTIVO NETO			24,045,305,279	-
	VAR ESTABLECIDO \$			36,067,958	0.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			7,525,690	0.03%

Cartera al:

12/29/2023

-

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.