

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.			111,259,165	10.37%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	59,971,989	5.59 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	51,287,177	4.78 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			128,208,900	11.95%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	50,151,553	4.68 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	39,992,970	3.73 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,064,377	3.55 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			25,786,061	2.40%
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	25,786,061	2.40 %
	Certificado Bursatil			270,929,989	25.26%
91	CETELEM	22	AAA(mex)	70,427,306	6.57 %
91	DESCB	22	AA+(mex)	55,727,949	5.20 %
91	LALA	19-2	AA(mex)	40,360,244	3.76 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	25,583,461	2.39 %
91	ENCAPCB	21	AAA(mex)	15,955,759	1.49 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	15,022,524	1.40 %
91	AXO	19-2	A+(mex)	14,854,776	1.39 %
91	CEMEX	23L	AA(mex)	14,480,939	1.35 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,092,702	1.22 %
91	ARA	23X	mxAA-	5,304,990	0.49 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			164,746,150	15.36%
BI	CETES	240111	AAA(mex)	130,732,474	12.19 %
BI	CETES	240404	AAA(mex)	34,013,676	3.17 %
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			187,587,603	17.49%
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	75,838,638	7.07 %
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	61,182,377	5.71 %
D8	GSF0325	FLOAT	AAA(mex)	50,566,588	4.72 %
	Notas Estruct. Int. a descuento			10,102,340	0.94%
D2	GS624	261105	AAA(mex)	10,102,340	0.94 %
	Udibonos UDIS			28,225,720	2.63%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	28,225,720	2.63 %
	Reportos			145,589,199	13.58%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	145,589,199	13.58 %
	TOTAL CARTERA			1,072,435,126	100.00%
	ACTIVO NETO			1,077,027,599	-
	VAR ESTABLECIDO \$			2,907,975	0.27%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			947,709	0.09%
	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 7 DÍAS.