

PRINMAS
AAA/2 MO
PRINCIPAL DEUDA 1, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			110,969,290	13.51%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	62,026,621	7.55 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	48,942,668	5.96 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			51,287,177	6.24%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	51,287,177	6.24 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			255,237,066	31.06%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	139,975,395	17.04 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	65,110,118	7.92 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	50,151,553	6.10 %
	Cetes			175,392,674	21.35%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	141,378,998	17.21 %
BI	CETES	240404	AAA(mex)	34,013,676	4.14 %
	Udibonos	UDIS		45,223,529	5.50%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	45,223,529	5.50 %
	Reportos			103,050,793	12.54%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	103,050,793	12.54 %
	Varios			80,517,347	9.80%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	80,517,347	9.80 %
	TOTAL CARTERA			821,677,875	100.00%
	ACTIVO NETO			816,429,947	-
	VAR ESTABLECIDO \$			3,347,363	0.41%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			854,097	0.10%
	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