

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			2,060,423,002	8.26%
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	979,706,276	3.93 %
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	351,729,602	1.41 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	325,581,682	1.30 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	302,038,107	1.21 %
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	101,367,336	0.41 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			2,530,021,217	10.14%
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	1,715,085,424	6.87 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	715,446,123	2.87 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	99,489,670	0.40 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			4,346,014,507	17.42%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	782,644,673	3.14 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	601,325,616	2.41 %
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	587,717,623	2.36 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	568,849,888	2.28 %
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	502,122,005	2.01 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	499,827,880	2.00 %
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	400,650,928	1.61 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	299,654,508	1.20 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	103,221,385	0.41 %
	Cetes			3,440,109,304	13.79%
BI	CETES	240215	AAA(mex)	1,391,288,920	5.58 %
BI	CETES	240418	AAA(mex)	591,700,187	2.37 %
BI	CETES	240502	AAA(mex)	427,958,307	1.72 %
BI	CETES	240711	AAA(mex)	403,136,520	1.62 %
BI	CETES	240404	AAA(mex)	330,971,105	1.33 %
BI	CETES	240208	AAA(mex)	225,741,302	0.90 %
BI	CETES	240822	AAA(mex)	69,312,963	0.28 %
	Reportos			8,597,626,348	34.46%
LF	BONDESF	240229	AAA(mex)	1,683,766,400	6.75 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	1,528,539,158	6.13 %
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	1,421,475,232	5.70 %
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	1,000,312,167	4.01 %
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	579,149,247	2.32 %
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	400,124,816	1.60 %
LF	BONDESF	250313	AAA(mex)	313,314,012	1.26 %
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	312,726,101	1.25 %
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	303,878,082	1.22 %
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	301,806,307	1.21 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	286,964,694	1.15 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	265,530,356	1.06 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	170,536,404	0.68 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	29,503,373	0.12 %
	Varios			3,977,285,588	15.94%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	1,078,618,550	4.32 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	703,980,802	2.82 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	502,013,810	2.01 %
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	488,972,112	1.96 %
LF	BONDESF	250102	AAA(mex)	301,748,382	1.21 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	300,483,732	1.20 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	200,876,084	0.81 %

LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	200,327,302	0.80 %
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	200,264,814	0.80 %
	TOTAL CARTERA			24,951,479,966	100.00%
	ACTIVO NETO			24,926,212,801	-
	VAR ESTABLECIDO \$			37,389,319	0.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			7,530,469	0.03%
	Cartera al:		1/25/2024		-

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 1 DÍA.