

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.			110,673,454	11.08%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	60,426,146	6.05 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	50,247,308	5.03 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			128,095,729	12.82%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	50,110,468	5.02 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	39,953,934	4.00 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,031,327	3.81 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			25,848,639	2.59%
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	25,848,639	2.59 %
	Certificado Bursatil			200,627,432	20.09%
91	DESCB	22	AA+(mex)	55,534,013	5.56 %
91	LALA	19-2	AA(mex)	40,302,548	4.03 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	25,762,601	2.58 %
91	ENCAPCB	21	AAA(mex)	15,920,642	1.59 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	15,162,100	1.52 %
91	AXO	19-2	A+(mex)	14,989,001	1.50 %
91	CEMEX	23L	AA(mex)	14,465,104	1.45 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,074,819	1.31 %
91	ARA	23X	mxAA-	5,297,265	0.53 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			207,812,246	20.81%
BI	CETES	240411	AAA(mex)	120,576,133	12.07 %
BI	CETES	240711	AAA(mex)	52,975,512	5.30 %
BI	CETES	240404	AAA(mex)	34,260,601	3.43 %
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			151,896,335	15.21%
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	50,892,951	5.10 %
D8	GSF0325	FLOAT	AAA(mex)	50,516,101	5.06 %
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	50,487,283	5.05 %
	Notas Estruct. Int. a descuento			10,088,160	1.01%
D2	GS624	261105	AAA(mex)	10,088,160	1.01 %
	Udibonos	UDIS		28,496,826	2.85%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	28,496,826	2.85 %
	Reportos			135,318,129	13.55%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	84,683,731	8.48 %
BI	CETES	251030	AAA(mex)	50,634,397	5.07 %
	TOTAL CARTERA			998,856,949	100.00%
	ACTIVO NETO			999,551,463	-
	VAR ESTABLECIDO \$			2,698,789	0.27%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			653,935	0.06%
	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 7 DÍAS.