

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			62,121,117	8.06%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	62,121,117	8.06 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			50,247,308	6.52%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	50,247,308	6.52 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			255,002,824	33.11%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	139,838,770	18.15 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	65,053,585	8.45 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	50,110,468	6.51 %
	Cetes			65,018,609	8.44%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	65,018,609	8.44 %
	Udibonos	UDIS		115,791,816	15.03%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	70,133,917	9.11 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	45,657,898	5.93 %
	Reportos			141,663,616	18.39%
BI	CETES	250710	AAA(mex)	99,484,332	12.92 %
BI	CETES	251030	AAA(mex)	42,179,284	5.48 %
	Varios			80,430,215	10.44%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	80,430,215	10.44 %
	TOTAL CARTERA			770,275,505	100.00%
	ACTIVO NETO			769,497,805	-
	VAR ESTABLECIDO \$			3,154,941	0.41%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,087,043	0.13%
	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