

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 Gob. Fed. Tasa fija			103,258,273	6.21%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	73,444,969	4.42 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	29,813,304	1.79 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			110,371,615	6.64%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	59,526,574	3.58 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	50,845,041	3.06 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			128,378,059	7.72%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	50,220,215	3.02 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	40,051,300	2.41 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,106,544	2.29 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			75,142,794	4.52%
94	BBVAMX	24-3	AAA(mex)	25,055,295	1.51 %
94	BANORTE	24X	AAA(mex)	25,050,441	1.51 %
94	BSMX	22-3	AAA(mex)	25,037,058	1.51 %
	Certificado Bursatil			493,399,587	29.66%
91	DAFCB	24	Aaa.mx	50,096,204	3.01 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	45,474,954	2.73 %
91	MEGA	24X	AAA(mex)	40,343,538	2.43 %
91	TOYOTA	24-2	AAA(mex)	39,698,873	2.39 %
91	VWLEASE	24	mxAAA	35,084,547	2.11 %
91	BWMX	21X	AA(mex)	34,131,910	2.05 %
91	GAP	24	mxAAA	30,037,049	1.81 %
91	ARA	21-2X	AA-(mex)	28,386,456	1.71 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	27,175,693	1.63 %
91	ARA	23X	mxAA-	26,398,425	1.59 %
91	AMX	22-2	AAA(mex)	26,056,306	1.57 %
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	25,075,327	1.51 %
91	SORIANA	24	AAA(mex)	25,044,942	1.51 %
91	ENGENCB	24-2	AAA(mex)	20,698,191	1.24 %
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	14,043,191	0.84 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,070,792	0.79 %
91	LALA	19	AA(mex)	12,463,848	0.75 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			573,928,512	34.50%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	154,384,706	9.28 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	84,390,876	5.07 %
BI	CETES	251016	AAA(mex)	73,441,320	4.42 %
BI	CETES	250724	AAA(mex)	64,739,340	3.89 %
BI	CETES	250626	AAA(mex)	62,388,916	3.75 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	39,189,594	2.36 %
BI	CETES	251113	AAA(mex)	34,178,895	2.05 %
BI	CETES	260806	AAA(mex)	30,702,316	1.85 %
BI	CETES	250918	AAA(mex)	30,512,549	1.83 %
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			111,224,602	6.69%
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	50,661,244	3.05 %
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	50,473,230	3.03 %
D8	GSG1126	FLOAT	AAA(mex)	10,090,128	0.61 %
	Reportos			67,714,166	4.07%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	67,714,166	4.07 %
	TOTAL CARTERA			1,663,417,608	100.00%
	ACTIVO NETO			1,673,389,414	-

VAR ESTABLECIDO \$

4,518,151 0.27%

VAR OBSERVADO PROMEDIO \$

1,881,638 0.12%

Cartera al:

11/29/2024

-

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.