

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			676,901,450	1.73%
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	351,361,199	0.90 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	325,540,251	0.83 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			1,824,509,683	4.66%
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	708,079,225	1.81 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	511,509,260	1.31 %
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	503,721,695	1.29 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	101,199,503	0.26 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			3,958,247,150	10.11%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	782,039,077	2.00 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	698,988,885	1.78 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	601,025,574	1.53 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	573,220,090	1.46 %
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	501,781,285	1.28 %
IM	BPAG28	270805	AAA(mex)	400,743,508	1.02 %
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	400,448,732	1.02 %
	Cetes			22,184,891,753	56.65%
BI	CETES	250320	AAA(mex)	3,163,220,635	8.08 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	2,327,391,566	5.94 %
BI	CETES	250416	AAA(mex)	2,276,064,770	5.81 %
BI	CETES	250626	AAA(mex)	1,834,042,005	4.68 %
BI	CETES	250724	AAA(mex)	1,812,326,436	4.63 %
BI	CETES	250918	AAA(mex)	1,712,307,496	4.37 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	1,633,081,632	4.17 %
BI	CETES	250123	AAA(mex)	1,548,934,562	3.96 %
BI	CETES	250529	AAA(mex)	1,422,686,282	3.63 %
BI	CETES	250220	AAA(mex)	1,185,511,387	3.03 %
BI	CETES	250430	AAA(mex)	896,460,382	2.29 %
BI	CETES	251016	AAA(mex)	780,907,473	1.99 %
BI	CETES	250904	AAA(mex)	579,118,998	1.48 %
BI	CETES	250821	AAA(mex)	538,912,080	1.38 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	473,926,050	1.21 %
	Reportos			3,827,104,914	9.77%
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	3,827,104,914	9.77 %
	Varios			6,690,129,564	17.08%
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	802,713,000	2.05 %
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	701,876,833	1.79 %
LF	BONDESF	250828	AAA(mex)	699,791,624	1.79 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	601,755,468	1.54 %
LF	BONDESF	261022	AAA(mex)	598,477,518	1.53 %
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	492,761,611	1.26 %
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	479,268,356	1.22 %
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	453,904,379	1.16 %
LF	BONDESF	260115	AAA(mex)	399,650,052	1.02 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	300,435,735	0.77 %
LF	BONDESF	260723	AAA(mex)	300,278,736	0.77 %
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	219,718,004	0.56 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	200,713,132	0.51 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	199,696,002	0.51 %
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	139,156,525	0.36 %
LF	BONDESF	251218	AAA(mex)	99,932,590	0.26 %

TOTAL CARTERA	39,161,784,513	100.00%
ACTIVO NETO	38,832,871,443	-
VAR ESTABLECIDO \$	58,249,307	0.15%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$	14,659,796	0.04%
Cartera al:	12/19/2024	-

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.