

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			136,344,368	7.62%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	73,344,878	4.10 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	62,999,490	3.52 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			110,956,035	6.20%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	59,845,175	3.35 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	51,110,860	2.86 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			128,029,585	7.16%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	50,085,465	2.80 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	39,942,222	2.23 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,001,899	2.12 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			75,545,154	4.22%
94	BBVAMX	24-3	AAA(mex)	25,187,846	1.41 %
94	BANORTE	24X	AAA(mex)	25,183,925	1.41 %
94	BSMX	22-3	AAA(mex)	25,173,384	1.41 %
	Certificado Bursatil			501,732,969	28.05%
91	DAFCB	24	Aaa.mx	50,412,311	2.82 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	45,699,262	2.56 %
91	MEGA	24X	AAA(mex)	40,214,850	2.25 %
91	TOYOTA	24-2	AAA(mex)	39,678,861	2.22 %
91	VWLEASE	24	mxAAA	35,292,591	1.97 %
91	BWMX	21X	AA(mex)	34,035,435	1.90 %
91	GAP	24	mxAAA	30,242,159	1.69 %
91	ARA	21-2X	AA-(mex)	28,409,607	1.59 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	27,330,680	1.53 %
91	ARA	23X	mxAA-	26,557,395	1.48 %
91	AMX	22-2	AAA(mex)	26,194,611	1.46 %
91	SORIANA	24	AAA(mex)	25,178,935	1.41 %
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	25,013,471	1.40 %
91	ENGENCB	24-2	AAA(mex)	20,678,983	1.16 %
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	14,120,976	0.79 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,020,850	0.73 %
91	LALA	19	AA(mex)	12,517,583	0.70 %
91	KOF	20-2	AAA(mex)	7,015,070	0.39 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			656,460,308	36.70%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	155,236,889	8.68 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	84,970,565	4.75 %
BI	CETES	251016	AAA(mex)	73,931,456	4.13 %
BI	CETES	250918	AAA(mex)	67,933,939	3.80 %
BI	CETES	250724	AAA(mex)	65,164,421	3.64 %
BI	CETES	250626	AAA(mex)	62,783,596	3.51 %
BI	CETES	261126	AAA(mex)	41,754,215	2.33 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	39,428,798	2.20 %
BI	CETES	251113	AAA(mex)	34,394,483	1.92 %
BI	CETES	260806	AAA(mex)	30,861,947	1.73 %
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			110,828,833	6.20%
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	50,468,938	2.82 %
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	50,303,612	2.81 %
D8	GSG1126	FLOAT	AAA(mex)	10,056,283	0.56 %
	Reportos			68,670,102	3.84%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	68,670,102	3.84 %

TOTAL CARTERA	1,788,567,354	100.00%
ACTIVO NETO	1,772,150,802	-
VAR ESTABLECIDO \$	4,784,807	0.27%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$	1,822,970	0.11%
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 7 DÍAS.