

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			202,698,177	37.97%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	140,098,497	26.24 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	31,213,383	5.85 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	11,481,007	2.15 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	10,002,123	1.87 %
M	BONOS	280302	AAA(mex)	9,903,167	1.86 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			51,110,860	9.57%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	51,110,860	9.57 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			30,051,279	5.63%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	30,051,279	5.63 %
	Cetes			143,791,055	26.94%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	55,296,109	10.36 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	35,205,287	6.59 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	27,571,370	5.16 %
BI	CETES	260806	AAA(mex)	25,718,289	4.82 %
	Udibonos	UDIS		92,572,540	17.34%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	61,837,797	11.58 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	15,834,883	2.97 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	14,899,860	2.79 %
	Reportos			13,602,446	2.55%
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	13,602,446	2.55 %
	TOTAL CARTERA			533,826,357	100.00%
	ACTIVO NETO			523,634,552	-
	VAR ESTABLECIDO \$			2,146,902	0.41%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,747,949	0.34%
	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