

# 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	%
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>48,382,421</b>	<b>5.44%</b>
M	BONOS	260903	AAA(mex)	28,391,001	3.19 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	19,991,420	2.25 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>110,896,311</b>	<b>12.48%</b>
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	60,561,672	6.82 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	50,334,640	5.66 %
	<b>Bonos Prot.Ahorro pago mensual</b>			<b>128,265,811</b>	<b>14.43%</b>
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	49,915,733	5.62 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	40,143,138	4.52 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,206,940	4.30 %
	<b>Cert. Bursatiles Bancarios</b>			<b>6,537,921</b>	<b>0.74%</b>
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	6,537,921	0.74 %
	<b>Certificado Bursatil</b>			<b>183,150,791</b>	<b>20.61%</b>
91	VWLEASE	24	mxAAA	35,214,088	3.96 %
91	DAFCB	24	Aaa.mx	30,065,560	3.38 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	26,106,102	2.94 %
91	ENCAPCB	21	AAA(mex)	15,957,044	1.80 %
91	AXO	19-2	A+(mex)	15,314,914	1.72 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	15,016,508	1.69 %
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	14,092,232	1.59 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,097,187	1.47 %
91	LALA	19-2	AA(mex)	12,845,944	1.45 %
91	ARA	23X	mxAA-	5,321,873	0.60 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	<b>Cetes</b>			<b>283,804,133</b>	<b>31.94%</b>
BI	CETES	260219	AAA(mex)	102,389,566	11.52 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	69,502,726	7.82 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	54,186,925	6.10 %
BI	CETES	240919	AAA(mex)	37,755,539	4.25 %
BI	CETES	260416	AAA(mex)	19,969,377	2.25 %
	<b>Eurobonos a Mediano Plazo MXP</b>			<b>111,288,309</b>	<b>12.52%</b>
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	51,039,072	5.74 %
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	50,214,562	5.65 %
D8	GSG1126	FLOAT	AAA(mex)	10,034,676	1.13 %
	<b>Reportos</b>			<b>16,301,902</b>	<b>1.83%</b>
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	16,301,902	1.83 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>888,627,601</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>889,590,860</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>2,401,895</b>	<b>0.27%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>747,664</b>	<b>0.09%</b>
	<b>Cartera al:</b>		4/30/2024		<b>-</b>

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 COMPOEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS.