

PRINFTR
AAA/4 MO
PRINCIPAL DEUDA R, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA
LARGO PLAZO TASA REAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			13,583,067	10.22%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	13,583,067	10.22 %
	Cetes			3,056,898	2.30%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	3,056,898	2.30 %
	Udibonos UDIS			109,035,807	82.01%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	40,946,776	30.80 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	40,808,598	30.69 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	22,810,695	17.16 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	4,469,738	3.36 %
	Reportos			7,285,076	5.48%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	7,285,076	5.48 %
	TOTAL CARTERA			132,960,847	100.00%
	ACTIVO NETO			132,734,934	-
	VAR ESTABLECIDO \$			955,692	0.72%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			653,316	0.49%
	Cartera al:		4/30/2024		-

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.