

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 Prot. Ahorro pago Trim.			50,334,640	9.13%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	50,334,640	9.13 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			240,689,007	43.64%
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	140,500,984	25.47 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	50,272,290	9.11 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	49,915,733	9.05 %
	Cetes			169,422,700	30.72%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	134,173,045	24.33 %
BI	CETES	260416	AAA(mex)	35,249,655	6.39 %
	Reportos			11,402,634	2.07%
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	11,402,634	2.07 %
	Varios			79,713,628	14.45%
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	79,713,628	14.45 %
	TOTAL CARTERA			551,562,609	100.00%
	ACTIVO NETO			545,778,875	-
	VAR ESTABLECIDO \$			2,237,693	0.41%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			632,842	0.11%
	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 7 DÍAS