

PRINFGU
AAA/1 MO
PRINCIPAL INSTITUCIONAL, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bondes D			676,156,714	2.35%
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	349,675,585	1.21 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	326,481,129	1.13 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			2,529,532,223	8.78%
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	1,714,500,640	5.95 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	715,562,246	2.48 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	99,469,336	0.35 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			4,159,660,766	14.44%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	784,796,455	2.72 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	701,192,842	2.43 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	597,857,274	2.08 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	570,443,369	1.98 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	501,058,135	1.74 %
IM	BPAG28	251106	AAA(mex)	499,116,090	1.73 %
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	401,730,580	1.39 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	103,466,020	0.36 %
	Cetes			12,666,214,630	43.98%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	3,499,824,648	12.15 %
BI	CETES	240808	AAA(mex)	1,751,383,565	6.08 %
BI	CETES	240613	AAA(mex)	1,530,207,106	5.31 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	1,502,008,355	5.21 %
BI	CETES	240711	AAA(mex)	1,196,070,581	4.15 %
BI	CETES	240620	AAA(mex)	653,399,398	2.27 %
BI	CETES	240530	AAA(mex)	544,321,965	1.89 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	541,683,030	1.88 %
BI	CETES	240509	AAA(mex)	338,656,626	1.18 %
BI	CETES	240919	AAA(mex)	305,965,156	1.06 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	302,381,352	1.05 %
BI	CETES	260416	AAA(mex)	279,312,037	0.97 %
BI	CETES	240725	AAA(mex)	149,770,909	0.52 %
BI	CETES	240822	AAA(mex)	71,229,902	0.25 %
	Reportos			2,585,050,595	8.97%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	2,545,776,920	8.84 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	39,273,675	0.14 %
	Varios			6,186,483,618	21.48%
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	1,072,462,284	3.72 %
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	803,165,616	2.79 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	699,743,954	2.43 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	598,826,328	2.08 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	499,224,315	1.73 %
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	490,392,181	1.70 %
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	402,609,528	1.40 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	301,408,434	1.05 %
LF	BONDESF	250102	AAA(mex)	299,911,716	1.04 %
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	218,803,801	0.76 %
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	200,830,776	0.70 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	200,364,490	0.70 %
LF	BONDESF	251009	AAA(mex)	199,723,684	0.69 %
LF	BONDESF	240523	AAA(mex)	199,016,511	0.69 %
	TOTAL CARTERA			28,803,098,545	100.00%
	ACTIVO NETO			28,774,100,261	-

VAR ESTABLECIDO \$

43,161,150 0.15%

VAR OBSERVADO PROMEDIO \$

10,421,726 0.04%

Cartera al:

4/25/2024

-

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.