

**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>48,311,991</b>	<b>5.48%</b>
M	BONOS	260903	AAA(mex)	28,333,097	3.21 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	19,978,894	2.26 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>110,685,833</b>	<b>12.54%</b>
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	60,448,794	6.85 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	50,237,039	5.69 %
	<b>Bonos Prot.Ahorro pago mensual</b>			<b>128,025,491</b>	<b>14.51%</b>
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	49,821,440	5.65 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	40,068,162	4.54 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	38,135,889	4.32 %
	<b>Cert. Bursatiles Bancarios</b>			<b>6,533,115</b>	<b>0.74%</b>
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	6,533,115	0.74 %
	<b>Certificado Bursatil</b>			<b>183,266,204</b>	<b>20.77%</b>
91	VWLEASE	24	mxAAA	35,145,047	3.98 %
91	DAFCB	24	Aaa.mx	30,344,045	3.44 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	26,053,212	2.95 %
91	ENCAPCB	21	AAA(mex)	15,921,993	1.80 %
91	AXO	19-2	A+(mex)	15,276,231	1.73 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	15,142,000	1.72 %
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	14,064,504	1.59 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	13,068,000	1.48 %
91	LALA	19-2	AA(mex)	12,821,380	1.45 %
91	ARA	23X	mxAA-	5,310,451	0.60 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	<b>Cetes</b>			<b>283,374,141</b>	<b>32.11%</b>
BI	CETES	260219	AAA(mex)	102,243,105	11.59 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	69,377,596	7.86 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	54,121,749	6.13 %
BI	CETES	240919	AAA(mex)	37,683,736	4.27 %
BI	CETES	260416	AAA(mex)	19,947,955	2.26 %
	<b>Eurobonos a Mediano Plazo MXP</b>			<b>111,065,666</b>	<b>12.59%</b>
D8	CIT1125	FLOAT	AAA(mex)	50,937,106	5.77 %
D8	MSF0925	FLOAT	AAA(mex)	50,114,193	5.68 %
D8	GSG1126	FLOAT	AAA(mex)	10,014,367	1.13 %
	<b>Reportos</b>			<b>11,131,822</b>	<b>1.26%</b>
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	11,131,822	1.26 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>882,394,263</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>883,064,920</b>	-
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>2,384,275</b>	<b>0.27%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>730,334</b>	<b>0.08%</b>
	<b>Cartera al:</b>		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 7 DÍAS.