

**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	%
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>13,569,284</b>	<b>10.21%</b>
M	BONOS	330526	AAA(mex)	13,569,284	10.21 %
	<b>Cetes</b>			<b>3,052,526</b>	<b>2.30%</b>
BI	CETES	260219	AAA(mex)	3,052,526	2.30 %
	<b>Udibonos UDIS</b>			<b>109,026,552</b>	<b>82.02%</b>
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	40,968,601	30.82 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	40,872,936	30.75 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	22,714,206	17.09 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	4,470,810	3.36 %
	<b>Reportos</b>			<b>7,271,743</b>	<b>5.47%</b>
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	7,271,743	5.47 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>132,920,103</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>132,715,356</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>955,551</b>	<b>0.72%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>647,416</b>	<b>0.48%</b>
	<b>Cartera al:</b>		4/25/2024		<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 1 DÍA.