

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	%
IS	BPAS 182 BPA182	180705	AAA(mex)	88,679,317 88,679,317	0.58 % 0.58 %
	Bondes D			5,066,716,228	33.36 %
LD	BONDESD	180328	AAA(mex)	740,889,719	4.88 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	651,638,611	4.29 %
LD	BONDESD	180927	AAA(mex)	639,957,651	4.21 %
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	581,238,973	3.83 %
LD	BONDESD	191205	AAA(mex)	520,257,254	3.43 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	400,944,320	2.64 %
LD	BONDESD	180705	AAA(mex)	399,280,664	2.63 %
LD	BONDESD	180419	AAA(mex)	395,955,901	2.61 %
LD	BONDESD	180104	AAA(mex)	341,140,482	2.25 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	140,128,374	0.92 %
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	129,903,900	0.86 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	125,380,377	0.83 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			3,581,779,157	23.58 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	1,001,193,170	6.59 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	648,475,505	4.27 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	627,241,451	4.13 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	576,240,364	3.79 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	264,483,320	1.74 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	242,001,521	1.59 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	222,143,825	1.46 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			962,179,995	6.34 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	325,224,153	2.14 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	290,435,194	1.91 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	230,995,967	1.52 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	115,524,682	0.76 %
	Cetes			755,579,919	4.98 %
BI	CETES	180315	AAA(mex)	309,923,640	2.04 %
BI	CETES	180215	AAA(mex)	214,265,304	1.41 %
BI	CETES	180301	AAA(mex)	145,687,140	0.96 %
BI	CETES	180816	AAA(mex)	85,703,835	0.56 %
	Reportos			4,732,274,540	31.16 %
M	BONOS	220609	AAA(mex)	1,714,404,065	11.29 %
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	1,250,146,363	8.23 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	766,559,946	5.05 %
IM	BPAG28	191121	AAA(mex)	550,900,566	3.63 %
LD	BONDESD	171019	AAA(mex)	450,263,600	2.96 %
	TOTAL CARTERA			15,187,209,155	100.00 %
	ACTIVO NETO			15,175,073,669	
	VAR ESTABLECIDO \$			4,552,522	0.03 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			171,291	0.00 %
	Cartera al:		9/29/2017		

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.