

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)	87,610,639 87,610,639	0.45 % 0.45 %
	Bondes D			5,370,125,585	27.49 %
LD	BONDESD	180328	AAA(mex)	739,946,192	3.79 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	650,810,784	3.33 %
LD	BONDESD	180927	AAA(mex)	642,596,678	3.29 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	636,757,915	3.26 %
LD	BONDESD	171221	AAA(mex)	616,701,453	3.16 %
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	440,872,793	2.26 %
LD	BONDESD	180705	AAA(mex)	400,987,391	2.05 %
LD	BONDESD	180419	AAA(mex)	395,449,913	2.02 %
LD	BONDESD	170824	AAA(mex)	365,348,542	1.87 %
LD	BONDESD	180104	AAA(mex)	340,712,589	1.74 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	139,941,336	0.72 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			2,350,905,102	12.04 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	630,032,152	3.23 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	579,257,582	2.97 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	261,230,889	1.34 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	243,118,378	1.24 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	223,162,921	1.14 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	212,050,484	1.09 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	202,052,696	1.03 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			962,591,524	4.93 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	326,581,765	1.67 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	289,977,847	1.48 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	230,668,424	1.18 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	115,363,489	0.59 %
	Cetes			2,152,290,731	11.02 %
BI	CETES	171221	AAA(mex)	583,555,440	2.99 %
BI	CETES	180104	AAA(mex)	402,528,918	2.06 %
BI	CETES	171109	AAA(mex)	286,331,592	1.47 %
BI	CETES	171012	AAA(mex)	270,379,890	1.38 %
BI	CETES	171026	AAA(mex)	219,335,080	1.12 %
BI	CETES	171123	AAA(mex)	217,120,862	1.11 %
BI	CETES	170928	AAA(mex)	173,038,950	0.89 %
	Renortos			8,609,256,917	44.08 %
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	2,342,007,421	11.99 %
M	BONOS	200611	AAA(mex)	2,226,452,722	11.40 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	1,674,764,542	8.57 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	1,549,218,042	7.93 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	572,128,635	2.93 %
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	244,685,556	1.25 %
	TOTAL CARTERA			19,532,780,500	100.00 %
	ACTIVO NETO			19,514,309,126	
	VAR ESTABLECIDO \$			5,854,293	0.03 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			276,151	0.00 %
	Cartera al:		7/31/2017		

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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.