

PRINCIPAL DEUDA 1, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			179,633,024	8.06 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	68,412,302	3.07 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	55,297,052	2.48 %
IS	BPA182	190411	AAA(mex)	40,845,680	1.83 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	15,077,990	0.68 %
	Bondes D			275,637,885	12.37 %
LD	BONDES D	171005	AAA(mex)	120,437,029	5.41 %
LD	BONDES D	180614	AAA(mex)	70,211,477	3.15 %
LD	BONDES D	181213	AAA(mex)	69,970,668	3.14 %
LD	BONDES D	181011	AAA(mex)	15,018,710	0.67 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			591,361,250	26.54 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	103,854,488	4.66 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	97,457,042	4.37 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	91,169,392	4.09 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	80,080,060	3.59 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	72,860,019	3.27 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	65,395,636	2.94 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	50,236,710	2.25 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	30,307,904	1.36 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			245,469,605	11.02 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	114,991,215	5.16 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	70,203,433	3.15 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	50,243,349	2.26 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	10,031,608	0.45 %
	Cetes			225,953,836	10.14 %
BI	CETES	171221	AAA(mex)	68,081,468	3.06 %
BI	CETES	171109	AAA(mex)	37,940,873	1.70 %
BI	CETES	171123	AAA(mex)	34,230,767	1.54 %
BI	CETES	180104	AAA(mex)	33,948,222	1.52 %
BI	CETES	180621	AAA(mex)	28,176,813	1.26 %
BI	CETES	171026	AAA(mex)	23,575,694	1.06 %
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			20,019,180	0.90 %
JI	CABEI	1-16	AAA(mex)	20,019,180	0.90 %
	Udibonos UDIS			309,253,911	13.88 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	83,089,656	3.73 %
S	UDIBONO	171214	AAA(mex)	69,661,148	3.13 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	65,246,334	2.93 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	35,129,536	1.58 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	30,279,048	1.36 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	25,848,188	1.16 %
	Valores paraestatales Rendim.			189,149,579	8.49 %
95	CFE	14	Aa1.mx	44,916,977	2.02 %
95	PEMEX	12	Aa3.mx	27,161,509	1.22 %
95	FEFA	17-2	AAA(mex)	22,142,628	0.99 %
95	FEFA	17	AAA(mex)	22,103,453	0.99 %
95	CEDEVIS	0810U	AAA(mex)	20,971,028	0.94 %
95	PEMEX	14	Aa3.mx	19,862,188	0.89 %
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	14,488,501	0.65 %
95	CFE	15	Aa1.mx	7,744,863	0.35 %
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	5,654,290	0.25 %
95	FEFA	17-4	AAA(mex)	4,104,141	0.18 %
	Reportos			191,631,433	8.60 %
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	80,015,721	3.59 %
LD	BONDES D	220317	AAA(mex)	80,015,663	3.59 %
LD	BONDES D	170824	AAA(mex)	31,600,050	1.42 %
	TOTAL CARTERA			2,228,109,703	100.00 %
	ACTIVO NETO			2,226,611,699	
	VAR ESTABLECIDO \$			8,461,124	0.38 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			999,169	0.05 %
	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 COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS