

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			181,737,980	8.31 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	69,166,773	3.16 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	55,971,568	2.56 %
IS	BPA182	190411	AAA(mex)	41,336,222	1.89 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	15,263,418	0.70 %
	Bondes D			270,752,080	12.38 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	85,200,668	3.90 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	70,302,999	3.21 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	70,064,187	3.20 %
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	30,146,411	1.38 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	15,037,814	0.69 %
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			21,363,334	0.98 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	21,363,334	0.98 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			563,502,565	25.77 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	103,313,534	4.72 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	97,011,995	4.44 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	90,750,570	4.15 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	81,082,605	3.71 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	75,404,129	3.45 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	65,077,556	2.98 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	50,862,177	2.33 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			245,555,807	11.23 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	115,172,577	5.27 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	70,303,120	3.21 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	50,034,485	2.29 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	10,045,625	0.46 %
	Cetes			236,388,024	10.81 %
BI	CETES	180816	AAA(mex)	78,090,484	3.57 %
BI	CETES	180315	AAA(mex)	56,182,263	2.57 %
BI	CETES	180301	AAA(mex)	53,418,618	2.44 %
BI	CETES	180215	AAA(mex)	48,696,660	2.23 %
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			20,097,206	0.92 %
JI	CABEI	1-16	AAA(mex)	20,097,206	0.92 %
	Udibonos UDIS			311,527,065	14.24 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	145,046,685	6.63 %
S	UDIBONO	171214	AAA(mex)	70,781,862	3.24 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	35,764,070	1.64 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	33,616,064	1.54 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	26,318,384	1.20 %
	Valores paraestatales Rendim.			189,990,815	8.69 %
95	CFE	14	Aa1.mx	45,079,113	2.06 %
95	PEMEX	12	Aa3.mx	27,036,412	1.24 %
95	FEFA	17-2	AAA(mex)	22,173,290	1.01 %
95	FEFA	17	AAA(mex)	22,129,634	1.01 %
95	CEDEVIS	0810U	AAA(mex)	21,338,875	0.98 %
95	PEMEX	14	Aa3.mx	19,957,377	0.91 %
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	14,784,064	0.68 %
95	CFE	15	Aa1.mx	7,718,741	0.35 %
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	5,663,922	0.26 %
95	FEFA	17-4	AAA(mex)	4,109,386	0.19 %
	Reportos			146,102,083	6.68 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	90,052,955	4.12 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	56,049,127	2.56 %
	TOTAL CARTERA			2,187,016,958	100.00 %
	ACTIVO NETO			2,185,493,938	
	VAR ESTABLECIDO \$			8,304,877	0.38 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			446,971	0.02 %
	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 7 DÍAS