

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)	87,756,750 87,756,750	0.47 % 0.47 %
	Bondes D			5,269,696,718	28.40 %
LD	BONDESD	180328	AAA(mex)	741,406,261	4.00 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	652,099,266	3.51 %
LD	BONDESD	180927	AAA(mex)	640,348,090	3.45 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	634,529,443	3.42 %
LD	BONDESD	191205	AAA(mex)	520,659,152	2.81 %
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	439,327,096	2.37 %
LD	BONDESD	180705	AAA(mex)	399,594,856	2.15 %
LD	BONDESD	180419	AAA(mex)	394,065,779	2.12 %
LD	BONDESD	170824	AAA(mex)	366,067,074	1.97 %
LD	BONDESD	180104	AAA(mex)	341,380,747	1.84 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	140,218,954	0.76 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			3,349,520,475	18.05 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	1,008,164,530	5.43 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	620,770,443	3.35 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	580,427,006	3.13 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	261,760,130	1.41 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	243,625,994	1.31 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	219,848,058	1.18 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	212,455,535	1.14 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	202,468,778	1.09 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			960,861,143	5.18 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	325,447,411	1.75 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	290,577,697	1.57 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	229,871,055	1.24 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	114,964,979	0.62 %
	Cetes			2,775,403,626	14.96 %
BI	CETES	171221	AAA(mex)	584,689,320	3.15 %
BI	CETES	180621	AAA(mex)	470,570,450	2.54 %
BI	CETES	180524	AAA(mex)	425,819,430	2.29 %
BI	CETES	180104	AAA(mex)	403,334,350	2.17 %
BI	CETES	180201	AAA(mex)	386,619,960	2.08 %
BI	CETES	171109	AAA(mex)	286,853,605	1.55 %
BI	CETES	171123	AAA(mex)	217,516,510	1.17 %
	Renortos			6,112,857,246	32.94 %
BI	CETES	180621	AAA(mex)	2,108,189,923	11.36 %
LD	BONDESD	180628	AAA(mex)	1,264,708,233	6.82 %
IM	BPAG28	191121	AAA(mex)	906,064,207	4.88 %
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	865,079,547	4.66 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	419,507,575	2.26 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	400,077,192	2.16 %
LD	BONDESD	210121	AAA(mex)	149,230,569	0.80 %
	TOTAL CARTERA			18,556,095,957	100.00 %
	ACTIVO NETO			18,542,394,683	
	VAR ESTABLECIDO \$			5,562,718	0.03 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			197,491	0.00 %
	Cartera al:		8/10/2017		

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.