

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	%
	BPAS 182			88,867	0.73 %
	VARIOS			88,867	0.73 %
	Bondes D			4,587,041	37.91 %
LD	BONDESD	180328	AAA(mex)	738,457	6.10 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	649,611	5.37 %
LD	BONDESD	180927	AAA(mex)	641,388	5.30 %
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	579,262	4.79 %
LD	BONDESD	191205	AAA(mex)	518,529	4.29 %
LD	BONDESD	180705	AAA(mex)	400,190	3.31 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	399,605	3.30 %
LD	BONDESD	180419	AAA(mex)	394,605	3.26 %
	VARIOS			265,393	2.19 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			3,584,428	29.62 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	1,003,197	8.29 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	649,824	5.37 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	628,561	5.19 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	577,433	4.77 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	260,299	2.15 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	242,508	2.00 %
	VARIOS			222,606	1.84 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			962,365	7.95 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	325,912	2.69 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	291,073	2.41 %
	VARIOS			345,380	2.85 %
	Cetes			810,993	6.70 %
BI	CETES	180315	AAA(mex)	310,567	2.57 %
	VARIOS			500,427	4.14 %
	Reportos			2,065,820	17.07 %
M	BONOS	200611	AAA(mex)	911,038	7.53 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	638,968	5.28 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	290,769	2.40 %
	VARIOS			225,044	1.86 %
	TOTAL CARTERA			12,099,514	100.00 %
	ACTIVO NETO			12,089,875	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,627	0.03 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			241	0.00 %
	Cartera al:		10/12/2017		

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.