

PRINGLP				AAAf/S6(mex)	
PRINCIPAL DEUDA LP, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA					
LARGO PLAZO GENERAL					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			882,059,196	89.79%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	358,440,946	36.49 %
M	BONOS	240905	AAA(mex)	189,324,805	19.27 %
M	BONOS	231207	AAA(mex)	118,027,408	12.02 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	79,827,185	8.13 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	75,375,910	7.67 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	61,062,942	6.22 %
	Udibonos	UDIS		93,869,283	9.56%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	86,088,210	8.76 %
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	4,875,709	0.50 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	2,905,364	0.30 %
	Reportos			6,404,723	0.65%
LD	BONDESD	210915	AAA(mex)	6,404,723	0.65 %
	TOTAL CARTERA			982,333,202	100.00%
	ACTIVO NETO			979,081,094	-
	VAR ESTABLECIDO \$			9,301,270	0.95%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,145,763	0.84%
	Cartera al:		10/30/2020		-
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.					