

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			838,836,996	83.92%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	360,175,165	36.03 %
M	BONOS	240905	AAA(mex)	190,816,727	19.09 %
M	BONOS	231207	AAA(mex)	139,115,662	13.92 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	82,303,085	8.23 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	66,426,358	6.65 %
	Udibonos	UDIS		144,107,993	14.42%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	111,339,878	11.14 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	27,768,139	2.78 %
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	4,999,976	0.50 %
	Reportos			16,632,391	1.66%
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	16,632,391	1.66 %
	TOTAL CARTERA			999,577,380	100.00%
	ACTIVO NETO			985,777,098	-
	VAR ESTABLECIDO \$			9,364,882	0.95%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			7,724,603	0.78%
	Cartera al:		11/19/2020		-
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.					