

PRINFTR
AAAf/S5(mex)
**PRINCIPAL DEUDA R, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA
LARGO PLAZO TASA REAL**

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			70,193,849	6.43%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	70,193,849	6.43 %
	Udibonos UDIS			1,007,799,808	92.36%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	516,954,163	47.37 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	328,281,309	30.08 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	131,901,218	12.09 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	19,927,387	1.83 %
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,735,730	0.98 %
	Reportos			13,212,865	1.21%
LD	BONDESD	210915	AAA(mex)	13,212,865	1.21 %
	TOTAL CARTERA			1,091,206,521	100.00%
	ACTIVO NETO			1,086,124,621	-
	VAR ESTABLECIDO \$			7,059,810	0.65%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			6,102,203	0.57%
	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.