

PRINFGU

AAAf/S2(mex)

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	%
	Bondes D			3,888,421,093	32.36%
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	969,770,438	8.07 %
LD	BONDESD	220324	AAA(mex)	817,722,931	6.81 %
LD	BONDESD	220421	AAA(mex)	800,626,696	6.66 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	600,559,878	5.00 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	350,110,177	2.91 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	349,630,974	2.91 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			441,901,302	3.68%
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	441,901,302	3.68 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			584,186,177	4.86%
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	584,186,177	4.86 %
	Cetes			3,587,066,482	29.85%
BI	CETES	210819	AAA(mex)	1,441,418,030	12.00 %
BI	CETES	210923	AAA(mex)	1,205,538,764	10.03 %
BI	CETES	211021	AAA(mex)	597,693,376	4.97 %
BI	CETES	211216	AAA(mex)	342,192,340	2.85 %
BI	CETES	210902	AAA(mex)	223,972	0.00 %
	Reportos			3,513,793,666	29.24%
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	798,785,989	6.65 %
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	700,080,614	5.83 %
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	569,697,466	4.74 %
LD	BONDESD	231005	AAA(mex)	498,821,362	4.15 %
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	429,718,511	3.58 %
IS	BPA182	210909	AAA(mex)	400,046,160	3.33 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	116,643,564	0.97 %
	TOTAL CARTERA			12,015,368,720	100.00%
	ACTIVO NETO			11,661,154,109	-
	VAR ESTABLECIDO \$			17,491,731	0.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,690,621	0.02%
	Cartera al:		6/30/2021		-

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 COMPOEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.