

PRINMAS

AAAf/S4(mex)

PRINCIPAL DEUDA 1, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bondes D			316,121,250	15.40%
LD	BONDESD	210819	AAA(mex)	140,218,628	6.83 %
LD	BONDESD	211118	AAA(mex)	60,915,986	2.97 %
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	49,972,505	2.43 %
LD	BONDESD	220721	AAA(mex)	40,003,736	1.95 %
LD	BONDESD	220428	AAA(mex)	25,010,395	1.22 %
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			705,113,904	34.35%
M	BONOS	230309	AAA(mex)	274,588,297	13.38 %
M	BONOS	220609	AAA(mex)	251,117,419	12.23 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	120,984,520	5.89 %
M	BONOS	241205	AAA(mex)	38,121,487	1.86 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	20,302,181	0.99 %
	Cetes			41,354,940	2.01%
BI	CETES	220331	AAA(mex)	41,354,940	2.01 %
	Udibonos	UDIS		989,324,905	48.19%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	676,028,181	32.93 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	178,987,868	8.72 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	79,497,596	3.87 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	54,811,260	2.67 %
	Reportos			1,011,767	0.05%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	1,011,767	0.05 %
	TOTAL CARTERA			2,052,926,766	100.00%
	ACTIVO NETO			2,054,202,915	-
	VAR ESTABLECIDO \$			8,422,232	0.41%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			5,614,080	0.28%
	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 7 DÍAS