

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			4,135,854,387	33.52%
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	969,886,157	7.86 %
LD	BONDESD	220324	AAA(mex)	817,821,959	6.63 %
LD	BONDESD	220421	AAA(mex)	800,723,720	6.49 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	598,746,900	4.85 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	349,672,572	2.83 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	349,052,631	2.83 %
LD	BONDESD	220519	AAA(mex)	249,950,449	2.03 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			441,954,625	3.58%
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	441,954,625	3.58 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			582,415,815	4.72%
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	582,415,815	4.72 %
	Cetes			3,587,397,720	29.07%
BI	CETES	210819	AAA(mex)	1,441,573,035	11.68 %
BI	CETES	210923	AAA(mex)	1,205,658,128	9.77 %
BI	CETES	211021	AAA(mex)	597,730,827	4.84 %
BI	CETES	211216	AAA(mex)	342,211,730	2.77 %
BI	CETES	210902	AAA(mex)	224,000	0.00 %
	Reportos			3,590,863,696	29.10%
BI	CETES	211118	AAA(mex)	828,599,897	6.72 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	706,741,138	5.73 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	540,546,094	4.38 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	500,058,046	4.05 %
LD	BONDESD	260409	AAA(mex)	483,751,106	3.92 %
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	448,348,509	3.63 %
BI	CETES	210826	AAA(mex)	82,818,907	0.67 %
	TOTAL CARTERA			12,338,486,244	100.00%
	ACTIVO NETO			11,983,856,430	-
	VAR ESTABLECIDO \$			17,975,785	0.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				-
	Cartera al:		1/Jul/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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.