

PRINFMP
AAAf/S3(mex)
PRINCIPAL S, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Cert. Bursatiles Bancarios			46,321,164	3.55%
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	46,321,164	3.55 %
	Certificado Bursatil			336,639,223	25.83%
91	AXO	19-2	HR A-	43,222,435	3.32 %
91	GPH	19-2	AAA(mex)	31,141,122	2.39 %
91	KOF	20-2	AAA(mex)	29,700,914	2.28 %
91	GAP	20	mxAAA	29,225,671	2.24 %
91	LALA	19	HR AA-	29,003,538	2.23 %
91	ALSEA	19-2	A-(mex)	28,723,627	2.20 %
91	GRUMA	18	mxAA+	26,016,902	2.00 %
91	FUNO	18	AAA(mex)	25,788,744	1.98 %
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	25,217,712	1.93 %
91	GAP	17	mxAAA	20,046,054	1.54 %
91	LIVEPOL	17-2	AAA(mex)	12,000,934	0.92 %
91	INCARSO	17	AA+(mex)	11,552,285	0.89 %
91	DAIMLER	19	AAA(mex)	7,576,969	0.58 %
91	GMXT	17-2	AAA(mex)	7,383,610	0.57 %
91	SORIANA	16	AA+(mex)	6,144,475	0.47 %
91	AUTLNCB	17	HR AA	3,774,891	0.29 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			577,132,246	44.28%
BI	CETES	211021	AAA(mex)	310,364,983	23.81 %
BI	CETES	210520	AAA(mex)	122,330,888	9.39 %
BI	CETES	220331	AAA(mex)	61,261,168	4.70 %
BI	CETES	210701	AAA(mex)	58,422,318	4.48 %
BI	CETES	210211	AAA(mex)	24,752,890	1.90 %
	Pag. Med. Pzo. a Descuento			9,000,000	0.69%
93	AEROMEX	00120	HR D	9,000,000	0.69 %
	Udibonos UDIS			284,750,921	21.85%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	127,997,675	9.82 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	78,764,334	6.04 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	77,988,912	5.98 %
	Valores paraestatales Rendim.			21,947,780	1.68%
95	CFE	18	AAA(mex)	21,947,780	1.68 %
	Reportos			27,502,670	2.11%
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	27,502,670	2.11 %
	TOTAL CARTERA			1,303,294,004	100.00%
	ACTIVO NETO			1,402,659,138	-
	VAR ESTABLECIDO \$			3,787,180	0.27%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,384,543	0.31%
	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 7 DÍAS.