

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			3,886,444,301	33.57%
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	971,263,438	8.39 %
LD	BONDESD	220324	AAA(mex)	816,470,764	7.05 %
LD	BONDESD	220421	AAA(mex)	799,405,728	6.90 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	599,588,736	5.18 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	350,160,510	3.02 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	349,555,126	3.02 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			441,269,044	3.81%
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	441,269,044	3.81 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			583,289,875	5.04%
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	583,289,875	5.04 %
	Cetes			5,888,677,200	50.86%
BI	CETES	210819	AAA(mex)	1,439,906,985	12.44 %
BI	CETES	211021	AAA(mex)	1,343,431,682	11.60 %
BI	CETES	210729	AAA(mex)	1,209,410,757	10.45 %
BI	CETES	210923	AAA(mex)	1,204,723,556	10.41 %
BI	CETES	211007	AAA(mex)	691,204,220	5.97 %
	Reportos			778,480,666	6.72%
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	690,075,127	5.96 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	66,043,519	0.57 %
BI	CETES	211104	AAA(mex)	22,362,020	0.19 %
	TOTAL CARTERA			11,578,161,086	100.00%
	ACTIVO NETO			11,570,964,234	-
	VAR ESTABLECIDO \$			17,356,446	0.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,775,560	0.02%
	Cartera al:		6/17/2021		-

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