

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	%
	Bondes D			385,631,228	30.57%
LD	BONDESD	200528	AAA(mex)	75,036,218	5.95 %
LD	BONDESD	210722	AAA(mex)	64,965,878	5.15 %
LD	BONDESD	191226	AAA(mex)	50,198,192	3.98 %
LD	BONDESD	191205	AAA(mex)	50,118,434	3.97 %
LD	BONDESD	200402	AAA(mex)	35,021,230	2.78 %
LD	BONDESD	200924	AAA(mex)	30,152,249	2.39 %
LD	BONDESD	210819	AAA(mex)	29,982,647	2.38 %
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	20,081,041	1.59 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	15,061,680	1.19 %
LD	BONDESD	190627	AAA(mex)	15,013,660	1.19 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			55,122,516	4.37%
IM	BPAG28	190725	AAA(mex)	35,029,934	2.78 %
IM	BPAG28	210211	AAA(mex)	20,092,582	1.59 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			43,036,210	3.41%
94	BANAMEX	10-2	AAA(mex)	43,036,210	3.41 %
	Certificado Bursatil			364,704,798	28.91%
91	AXO	19-2	A(mex)	38,094,247	3.02 %
91	AMX	10-2	AAA(mex)	30,619,799	2.43 %
91	ALSEA	19-2	A+(mex)	26,217,758	2.08 %
91	GRUMA	18	mxAA+	26,188,628	2.08 %
91	FUNO	18	AAA(mex)	26,048,963	2.06 %
91	INCARSO	17	AA+(mex)	23,133,375	1.83 %
91	GAP	17	mxAAA	20,129,769	1.60 %
91	GMFIN	17	AA+(mex)	20,022,837	1.59 %
91	TLEVISA	10	Aa l.mx	15,515,132	1.23 %
91	HERDEZ	17-2	AA(mex)	15,110,332	1.20 %
91	DAIMLER	19-2	AAA(mex)	13,788,193	1.09 %
91	TLEVISA	15	Aa l.mx	12,945,554	1.03 %
91	TLEVISA	14	Aa l.mx	12,942,126	1.03 %
91	SORIANA	16	AA+(mex)	12,132,807	0.96 %
91	OSM	15-2	mxAA-	12,064,773	0.96 %
91	LIVEPOL	17-2	AAA(mex)	11,993,768	0.95 %
91	HOLCIM	15	AAA(mex)	10,062,792	0.80 %
91	ACBE	17-2	AAA(mex)	9,024,249	0.72 %
91	GMXT	17-2	AAA(mex)	7,420,687	0.59 %
91	AUTLNCB	17	HR AA	7,330,397	0.58 %
91	DAIMLER	19	AAA(mex)	7,280,178	0.58 %
91	GMFIN	18	AA+(mex)	6,519,096	0.52 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Pag. Med. Pzo. a Descuento			60,206,652	4.77%
93	AEROMEX	00119	HR2	60,206,652	4.77 %
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			30,054,882	2.38%
JI	CABEI	1-18	AAA(mex)	20,017,777	1.59 %
JI	CABEI	1-16	AAA(mex)	10,037,105	0.80 %
	Udibonos UDIS			64,845,619	5.14%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	26,778,481	2.12 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	25,038,725	1.98 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	13,028,414	1.03 %
	Valores paraestatales Rendim.			22,078,994	1.75%
95	CFE	18	AAA(mex)	22,078,994	1.75 %
	Reportos			235,960,928	18.70%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	235,960,928	18.70 %
	TOTAL CARTERA			1,261,641,828	100.00%
	ACTIVO NETO			1,248,673,557	-
	VAR ESTABLECIDO \$			3,371,419	0.27%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			506,735	0.04%
	Cartera al:		5/31/2019		-

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.