

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			114,834,548	7.56%
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	79,857,220	5.26 %
LD	BONDESD	220324	AAA(mex)	34,977,328	2.30 %
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			32,132,202	2.12%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	16,283,210	1.07 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	15,848,993	1.04 %
	Bonos Prot.Ahorro pago mensual			104,693,055	6.89%
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	104,693,055	6.89 %
	Cert. Bursatiles Bancarios			44,196,920	2.91%
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	44,196,920	2.91 %
	Certificado Bursatil			291,939,202	19.22%
91	AXO	19-2	HR A-	39,954,720	2.63 %
91	KOF	20-2	AAA(mex)	29,792,430	1.96 %
91	GAP	20	mxAAA	29,620,513	1.95 %
91	ALSEA	19-2	A-(mex)	27,635,255	1.82 %
91	LALA	19	HR AA-	27,145,778	1.79 %
91	GRUMA	18	mxAA+	26,061,156	1.72 %
91	FUNO	18	AAA(mex)	25,921,841	1.71 %
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	24,992,641	1.65 %
91	GAP	17	mxAAA	20,072,225	1.32 %
91	LIVEPOL	17-2	AAA(mex)	12,024,858	0.79 %
91	INCARSO	17	AA+(mex)	11,519,612	0.76 %
91	DAIMLER	19	AAA(mex)	7,483,272	0.49 %
91	GMXT	17-2	AAA(mex)	7,396,979	0.49 %
91	AUTLNCB	17	HR AA	2,198,581	0.14 %
91	METROCB	04	mxD	119,340	0.01 %
	Cetes			621,524,326	40.91%
BI	CETES	211021	AAA(mex)	303,578,106	19.98 %
BI	CETES	211118	AAA(mex)	147,304,005	9.70 %
BI	CETES	220407	AAA(mex)	91,514,232	6.02 %
BI	CETES	210923	AAA(mex)	79,127,984	5.21 %
	Pag. Med. Pzo. a Descuento			22,050,000	1.45%
93	AEROMEX	00120	HR D	22,050,000	1.45 %
	Udibonos UDIS			257,134,283	16.93%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	257,134,283	16.93 %
	Reportos			30,724,222	2.02%
BI	CETES	211104	AAA(mex)	30,724,222	2.02 %
	TOTAL CARTERA			1,519,228,757	100.00%
	ACTIVO NETO			1,502,840,620	-
	VAR ESTABLECIDO \$			4,057,670	0.27%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,706,989	0.18%
	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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS.