

PRINLS1

PRINCIPAL SAM I, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE

DISCRECIONAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Ind.,Com. y de Serv.			35,920,349	3.14%
1	TRAXION	A	Alta	5,399,031	0.47 %
1	FEMSA	UBD	Alta	4,795,700	0.42 %
1	VOLAR	A	Alta	4,256,000	0.37 %
1	CEMEX	CPO	Alta	3,810,004	0.33 %
1	ALFA	A	Alta	3,423,640	0.30 %
1	ALSEA	*	Alta	2,957,776	0.26 %
1	KIMBER	A	Alta	2,500,135	0.22 %
1	GENTERA	*	Alta	2,494,764	0.22 %
1	ASUR	B	Alta	2,487,300	0.22 %
1	R	A	Alta	1,898,559	0.17 %
1	LAB	B	Alta	1,897,440	0.17 %
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			129,908,018	11.37%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	129,908,018	11.37 %
	Cert. Burs. Fiduc. Inmob.			1,862,000	0.16%
CF	FIBRAMQ	12	Alta	1,862,000	0.16 %
	Chequera dolares			100,512	0.01%
CHD	40-002	9079993	N/A	100,512	0.01 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			176,885,949	15.48%
52	PRINRVA	FFX	N/A	94,096,658	8.23 %
52	GLREITS	FFX	N/A	43,396,048	3.80 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	39,393,243	3.45 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			567,170,633	49.63%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	455,500,668	39.86 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	111,669,965	9.77 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			207,458,745	18.15%
1ISP	SHV	*	N/A	122,949,383	10.76 %
1ISP	IVV	*	N/A	76,985,693	6.74 %
1ISP	IJH	*	N/A	7,523,669	0.66 %
	Reportos			23,577,177	2.06%
BI	CETES	240104	AAA(mex)	23,577,177	2.06 %
	TOTAL CARTERA			1,142,883,382	100.00%
	ACTIVO NETO			1,142,701,911	-
	VAR ESTABLECIDO \$			12,912,532	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			5,341,289	0.46%
	Cartera al:		12/29/2023		-

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.