

PRINLS3

PRINCIPAL SAM III, 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.			29,371,603	4.17%
1	TRAXION	A	Alta	4,333,845	0.62 %
1	FEMSA	UBD	Alta	3,823,300	0.54 %
1	VOLAR	A	Alta	3,472,912	0.49 %
1	CEMEX	CPO	Alta	3,096,124	0.44 %
1	KIMBER	A	Alta	2,982,184	0.42 %
1	ALFA	A	Alta	2,591,600	0.37 %
1	GENTERA	*	Alta	2,004,300	0.28 %
1	ASUR	B	Alta	1,989,840	0.28 %
1	ALSEA	*	Alta	1,813,996	0.26 %
1	R	A	Alta	1,720,062	0.24 %
1	LAB	B	Alta	1,543,440	0.22 %
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			38,684,331	5.49%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	38,684,331	5.49 %
	Cert. Burs. Fiduc. Inmob.			1,253,525	0.18%
CF	FIBRAMQ	12	Alta	1,253,525	0.18 %
	Chequera dolares			18,373	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	18,373	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			330,344,165	46.91%
52	PEMERGE	FFX	N/A	181,834,834	25.82 %
52	PRINRVA	FFX	N/A	115,878,918	16.45 %
52	GLREITS	FFX	N/A	32,630,414	4.63 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			301,119,851	42.76%
1ISP	SHV	*	N/A	93,426,583	13.27 %
1ISP	IVV	*	N/A	54,295,173	7.71 %
1ISP	VOO	*	N/A	50,765,425	7.21 %
1ISP	EWJ	*	N/A	45,009,512	6.39 %
1ISP	IJH	*	N/A	30,094,676	4.27 %
1ISP	VGK	*	N/A	27,528,482	3.91 %
	Reportos			3,457,078	0.49%
BI	CETES	240104	AAA(mex)	3,457,078	0.49 %
	TOTAL CARTERA			704,248,926	100.00%
	ACTIVO NETO			701,098,297	-
	VAR ESTABLECIDO \$			21,173,169	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,671,343	1.08%
	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.