

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	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			24,503,737	3.55%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	24,503,737	3.55 %
	Chequera dolares			18,637	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	18,637	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			242,737,586	35.19%
52	PRINRVA	FFX	N/A	122,801,525	17.80 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	88,180,027	12.78 %
52	GLREITS	FFX	N/A	31,756,034	4.60 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			372,429,659	54.00%
1ISP	IVV	*	N/A	99,578,129	14.44 %
1ISP	VOO	*	N/A	74,487,474	10.80 %
1ISP	SHV	*	N/A	56,487,391	8.19 %
1ISP	CBU0	N	N/A	43,828,948	6.35 %
1ISP	VGK	*	N/A	34,418,103	4.99 %
1ISP	EWJ	*	N/A	33,309,394	4.83 %
1ISP	IJH	*	N/A	30,320,220	4.40 %
	Reportos			50,038,212	7.25%
BI	CETES	250904	AAA(mex)	50,038,212	7.25 %
	TOTAL CARTERA			689,727,831	100.00%
	ACTIVO NETO			690,470,976	-
	VAR ESTABLECIDO \$			20,852,223	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			7,117,407	1.04%
	Cartera al:		1/25/2024		-

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.