

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 Gov. Fed. Tasa fija			35,541,327	4.87%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	15,824,943	2.17 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	13,664,431	1.87 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	6,051,954	0.83 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			31,304,805	4.29%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	30,184,280	4.13 %
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	1,120,525	0.15 %
	Cetes			11,947,587	1.64%
BI	CETES	261001	AAA(mex)	11,947,587	1.64 %
	Chequera dolares			22,049	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	22,049	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			195,269,444	26.74%
52	PRINRVA	FFX	N/A	91,870,015	12.58 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	74,825,225	10.25 %
52	GLREITS	FFX	N/A	28,574,204	3.91 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			6,706,682	0.92%
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	6,706,682	0.92 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			413,185,598	56.58%
1ISP	IVV	*	N/A	138,327,734	18.94 %
1ISP	VOO	*	N/A	61,077,171	8.36 %
1ISP	EWJ	*	N/A	44,356,848	6.07 %
1ISP	SHY	*	N/A	38,249,190	5.24 %
1ISP	IJH	*	N/A	34,857,389	4.77 %
1ISP	CBU7	N	N/A	33,612,287	4.60 %
1ISP	VGK	*	N/A	27,767,613	3.80 %
1ISP	CBU0	N	N/A	19,151,722	2.62 %
1ISP	RSP	*	N/A	7,640,299	1.05 %
1ISP	SHV	*	N/A	6,525,010	0.89 %
1ISP	MEXS	N	N/A	1,620,336	0.22 %
	Udibonos	UDIS		16,244,845	2.22%
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	9,712,540	1.33 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	6,532,305	0.89 %
	Reportos			17,425,996	2.39%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	17,425,996	2.39 %
	Varios			2,563,615	0.35%
1I	IDTXX	N	Alta	2,563,615	0.35 %
	TOTAL CARTERA			730,211,949	100.00%
	ACTIVO NETO			724,484,814	-
	VAR ESTABLECIDO \$			21,879,441	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,866,967	1.23%
	Cartera al:		11/29/2024		-

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.