

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			14,661,228	2.24%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	14,661,228	2.24 %
	Cetes			9,914,264	1.51%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	9,914,264	1.51 %
	Chequera dolares			18,546	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	18,546	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			219,918,934	33.53%
52	PRINRVA	FFX	N/A	103,720,886	15.81 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	89,506,648	13.65 %
52	GLREITS	FFX	N/A	26,691,401	4.07 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			392,019,236	59.77%
1ISP	IVV	*	N/A	107,716,575	16.42 %
1ISP	VOO	*	N/A	69,939,951	10.66 %
1ISP	SHV	*	N/A	68,670,053	10.47 %
1ISP	EWJ	*	N/A	40,393,321	6.16 %
1ISP	VGK	*	N/A	33,786,622	5.15 %
1ISP	IJH	*	N/A	31,310,531	4.77 %
1ISP	IEI	*	N/A	20,410,864	3.11 %
1ISP	SHY	*	N/A	19,791,319	3.02 %
	Reportos			19,343,015	2.95%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	19,343,015	2.95 %
	TOTAL CARTERA			655,875,224	100.00%
	ACTIVO NETO			659,182,460	-
	VAR ESTABLECIDO \$			19,907,310	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			6,612,078	0.99%
	Cartera al:		4/30/2024		-

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.