

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	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			166,108,561	15.60%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	98,738,478	9.27 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	41,979,143	3.94 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	25,390,940	2.38 %
	Cetes			60,266,754	5.66%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	60,266,754	5.66 %
	Chequera dolares			101,975	0.01%
CHD	40-002	9079993	N/A	101,975	0.01 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			138,620,875	13.02%
52	PRINRVA	FFX	N/A	94,778,972	8.90 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	23,075,236	2.17 %
52	GLREITS	FFX	N/A	20,766,667	1.95 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			446,821,876	41.96%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	252,636,036	23.72 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	90,404,878	8.49 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me)	45,640,784	4.29 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	36,157,905	3.40 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	21,982,275	2.06 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			191,233,793	17.96%
1ISP	IVV	*	N/A	95,602,675	8.98 %
1ISP	IEI	*	N/A	27,340,361	2.57 %
1ISP	SHV	*	N/A	23,257,485	2.18 %
1ISP	SHY	*	N/A	13,975,722	1.31 %
1ISP	EWJ	*	N/A	11,999,306	1.13 %
1ISP	VGK	*	N/A	11,115,200	1.04 %
1ISP	IJH	*	N/A	7,943,044	0.75 %
	Udibonos UDIS			36,943,318	3.47%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	36,943,318	3.47 %
	Reportos			24,897,855	2.34%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	24,897,855	2.34 %
	TOTAL CARTERA			1,064,995,006	100.00%
	ACTIVO NETO			1,062,981,839	-
	VAR ESTABLECIDO \$			12,011,695	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,334,808	0.41%
	Cartera al:		4/25/2024		-

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.