

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			140,659,364	13.35%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	39,735,467	3.77 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	35,740,086	3.39 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	33,138,990	3.15 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	18,092,667	1.72 %
M	BONOS	280302	AAA(mex)	13,952,154	1.32 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			31,929,840	3.03%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	20,823,600	1.98 %
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	11,106,240	1.05 %
	Cetes			85,310,227	8.10%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	63,879,778	6.06 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	21,430,449	2.03 %
	Chequera dolares			123,712	0.01%
CHD	40-002	9079993	N/A	123,712	0.01 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			119,029,434	11.30%
52	PRINRVA	FFX	N/A	83,880,599	7.96 %
52	GLREITS	FFX	N/A	19,804,007	1.88 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	15,344,828	1.46 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			442,279,124	41.99%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	240,972,238	22.88 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me	95,975,445	9.11 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me	67,047,566	6.37 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	38,255,435	3.63 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	28,439	0.00 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			166,025,075	15.76%
1ISP	IVV	*	N/A	79,415,012	7.54 %
1ISP	CBU7	N	N/A	37,469,310	3.56 %
1ISP	RSP	*	N/A	16,320,525	1.55 %
1ISP	EWJ	*	N/A	13,273,971	1.26 %
1ISP	MEXS	N	N/A	8,026,959	0.76 %
1ISP	EDV	*	N/A	4,284,996	0.41 %
1ISP	LQDA	N	N/A	3,629,312	0.34 %
1ISP	CBU0	N	N/A	2,677,184	0.25 %
1ISP	VGK	*	N/A	927,806	0.09 %
	Udibonos	UDIS		42,794,219	4.06%
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	18,988,693	1.80 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	14,852,157	1.41 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	8,953,368	0.85 %
	Reportos			1,573,059	0.15%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	1,573,059	0.15 %
	Varios			23,552,115	2.24%
1I	IDTXX	N	Alta	23,552,115	2.24 %
	TOTAL CARTERA			1,053,276,170	100.00%
	ACTIVO NETO			1,055,037,239	-
	VAR ESTABLECIDO \$			11,921,921	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,283,119	0.40%
	Cartera al:			12/31/2024	-

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.