

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			9,520,250	1.34%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	9,520,250	1.34 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			6,220,800	0.88%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	6,220,800	0.88 %
	Cetes			12,336,565	1.74%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	10,352,302	1.46 %
BI	CETES	250904	AAA(mex)	1,984,263	0.28 %
	Chequera dolares			21,336	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	21,336	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			219,106,359	30.91%
52	PRINRVA	FFX	N/A	96,327,886	13.59 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	90,450,214	12.76 %
52	GLREITS	FFX	N/A	32,328,260	4.56 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			19,374,871	2.73%
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	12,749,362	1.80 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	6,625,509	0.93 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			408,813,689	57.67%
1ISP	IVV	*	N/A	133,640,735	18.85 %
1ISP	SHV	*	N/A	71,475,091	10.08 %
1ISP	VOO	*	N/A	67,364,792	9.50 %
1ISP	EWJ	*	N/A	44,326,784	6.25 %
1ISP	VGK	*	N/A	35,864,364	5.06 %
1ISP	IJH	*	N/A	30,972,763	4.37 %
1ISP	CBU0	N	N/A	14,782,120	2.09 %
1ISP	EDV	*	N/A	8,803,807	1.24 %
1ISP	MEXS	N	N/A	1,583,235	0.22 %
	Udibonos	UDIS		15,061,389	2.12%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	6,386,647	0.90 %
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	6,200,751	0.87 %
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	2,473,990	0.35 %
	Reportos			15,749,309	2.22%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	15,749,309	2.22 %
	Varios			2,620,800	0.37%
1I	IDTXX	N	Alta	2,620,800	0.37 %
	TOTAL CARTERA			708,825,368	100.00%
	ACTIVO NETO			706,667,423	-
	VAR ESTABLECIDO \$			21,341,356	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,223,664	1.21%
	Cartera al:		8/30/2024		-

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.