

## 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	%
	<b>CPOs sobre Acciones del IPC</b>			<b>19,908,000</b>	<b>1.87%</b>
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	19,908,000	1.87 %
	<b>Chequera dolares</b>			<b>19,729</b>	<b>- %</b>
CHD	40-002	9079977	N/A	19,729	0.00 %
	<b>Soc. de Inv. de Renta Variable</b>			<b>473,200,370</b>	<b>44.41%</b>
52	PRINRVA	FFR	N/A	219,580,659	20.61 %
52	PEMERGE	FFR	N/A	208,229,852	19.54 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	40,580,324	3.81 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	4,809,536	0.45 %
	<b>Sociedad de Inversion de Deuda</b>			<b>130,046,565</b>	<b>12.20%</b>
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	40,661,558	3.82 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	37,165,165	3.49 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me)	36,120,747	3.39 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me)	11,596,143	1.09 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	4,502,953	0.42 %
	<b>TRAC Tit. ref. acciones extr.</b>			<b>396,950,564</b>	<b>37.25%</b>
1ISP	VT	*	N/A	161,546,408	15.16 %
1ISP	IVV	*	N/A	110,790,915	10.40 %
1ISP	KWEB	*	N/A	41,676,062	3.91 %
1ISP	EZU	*	N/A	17,388,501	1.63 %
1ISP	SHV	*	N/A	16,630,059	1.56 %
1ISP	VOO	*	N/A	11,901,470	1.12 %
1ISP	FBT	*	N/A	11,139,167	1.05 %
1ISP	VLUE	*	N/A	10,728,346	1.01 %
1ISP	ERUS	*	N/A	9,240,810	0.87 %
1ISP	VGK	*	N/A	5,908,826	0.55 %
	<b>Udibonos UDIS</b>			<b>22,568,981</b>	<b>2.12%</b>
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	11,290,029	1.06 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	11,278,953	1.06 %
	<b>Reportos</b>			<b>22,854,252</b>	<b>2.14%</b>
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	22,854,252	2.14 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,065,548,461</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,099,466,862</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>33,203,899</b>	<b>3.02%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>10,967,108</b>	<b>1.00%</b>
	<b>Cartera al:</b>		2/28/2020		<b>-</b>

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.