

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			136,587,984	13.17%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	35,969,803	3.47 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	34,771,620	3.35 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	33,594,168	3.24 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	18,199,756	1.75 %
M	BONOS	280302	AAA(mex)	14,052,638	1.35 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			33,781,824	3.26%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	21,000,000	2.02 %
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	12,781,824	1.23 %
	Cetes			64,218,063	6.19%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	64,218,063	6.19 %
	Chequera dolares			123,332	0.01%
CHD	40-002	9079993	N/A	123,332	0.01 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			118,900,428	11.46%
52	PRINRVA	FFX	N/A	84,088,806	8.11 %
52	GLREITS	FFX	N/A	19,611,284	1.89 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	15,200,337	1.47 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			444,828,951	42.89%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	242,276,537	23.36 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	96,443,560	9.30 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	67,446,398	6.50 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	38,633,889	3.72 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me)	28,567	0.00 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			164,772,311	15.89%
1ISP	IVV	*	N/A	78,422,330	7.56 %
1ISP	CBU7	N	N/A	37,306,659	3.60 %
1ISP	RSP	*	N/A	16,636,186	1.60 %
1ISP	EWJ	*	N/A	12,986,644	1.25 %
1ISP	MEXS	N	N/A	8,004,655	0.77 %
1ISP	EDV	*	N/A	4,218,835	0.41 %
1ISP	LQDA	N	N/A	3,593,772	0.35 %
1ISP	CBU0	N	N/A	2,659,916	0.26 %
1ISP	VGK	*	N/A	943,316	0.09 %
	Udibonos UDIS			43,002,238	4.15%
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	19,049,875	1.84 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	14,912,919	1.44 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	9,039,445	0.87 %
	Reportos			2,174,470	0.21%
IS	BPA182	280928	AAA(mex)	2,174,470	0.21 %
	Varios			28,815,100	2.78%
1I	IDTXX	N	Alta	28,815,100	2.78 %
	TOTAL CARTERA			1,037,204,702	100.00%
	ACTIVO NETO			1,055,527,389	-
	VAR ESTABLECIDO \$			11,927,459	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,253,030	0.40%
	Cartera al:		1/16/2025		-

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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.