

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	%
	Chequera dolares			19,940	- %
CHD	40-002	9079993	N/A	19,940	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			530,902,468	13.43%
52	PRINRVA	FFX	N/A	241,893,758	6.12 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	187,296,998	4.74 %
52	PRGLOB	FFX	N/A	90,075,171	2.28 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	11,636,540	0.29 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			2,647,406,211	66.96%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	599,969,440	15.17 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me	594,333,990	15.03 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	523,372,761	13.24 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me	434,237,262	10.98 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	295,907,039	7.48 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	199,585,719	5.05 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			548,348,769	13.87%
1ISP	EEM	*	N/A	106,775,074	2.70 %
1ISP	EZU	*	N/A	86,098,215	2.18 %
1ISP	VOO	*	N/A	75,145,310	1.90 %
1ISP	VDST	N	N/A	66,022,482	1.67 %
1ISP	LQD	*	N/A	42,198,731	1.07 %
1ISP	VTV	*	N/A	38,441,336	0.97 %
1ISP	EWU	*	N/A	20,421,169	0.52 %
1ISP	JETS	*	N/A	20,152,858	0.51 %
1ISP	RING	*	N/A	19,823,052	0.50 %
1ISP	MCHI	*	N/A	19,278,095	0.49 %
1ISP	EWZ	*	N/A	16,106,654	0.41 %
1ISP	EWC	*	N/A	8,225,209	0.21 %
1ISP	KWEB	*	N/A	5,235,221	0.13 %
1ISP	WTAI	N	N/A	3,634,087	0.09 %
1ISP	HERO	*	N/A	3,611,913	0.09 %
1ISP	QQQ	*	N/A	3,480,633	0.09 %
1ISP	WCLD	*	N/A	3,422,484	0.09 %
1ISP	FIVG	*	N/A	3,276,185	0.08 %
1ISP	ICLN	*	N/A	3,063,387	0.08 %
1ISP	FINX	*	N/A	2,363,716	0.06 %
1ISP	VOLT	N	N/A	1,572,959	0.04 %
	Udibonos	UDIS		192,652,893	4.87%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	192,652,893	4.87 %
	Reportos			34,377,759	0.87%
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	34,377,759	0.87 %
	TOTAL CARTERA			3,953,708,041	100.00%
	ACTIVO NETO			3,952,280,251	-
	VAR ESTABLECIDO \$			44,660,767	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			12,709,218	0.32%
	Cartera al:		9/Sep/2021		-

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.