

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	%
	CPOs sobre Acciones del IPC			41,674,500	2.36%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	41,674,500	2.36 %
	Chequera dolares			19,940	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	19,940	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			565,339,749	32.01%
52	PRINRVA	FFX	N/A	283,329,504	16.04 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	256,968,544	14.55 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	19,929,064	1.13 %
52	PRGLOB	FFX	N/A	5,112,636	0.29 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			243,295,743	13.78%
51	PRINFGU	FFX	AAA/2	88,918,138	5.03 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me	56,450,280	3.20 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	40,079,268	2.27 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me	39,956,342	2.26 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me	12,837,289	0.73 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	5,054,426	0.29 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			852,911,130	48.29%
1ISP	VT	*	N/A	181,211,059	10.26 %
1ISP	IVV	*	N/A	170,479,741	9.65 %
1ISP	EZU	*	N/A	116,389,041	6.59 %
1ISP	VOO	*	N/A	75,227,616	4.26 %
1ISP	EEM	*	N/A	47,886,368	2.71 %
1ISP	VTV	*	N/A	27,577,480	1.56 %
1ISP	VDST	N	N/A	25,009,649	1.42 %
1ISP	JETS	*	N/A	17,404,741	0.99 %
1ISP	QQQ	*	N/A	16,722,172	0.95 %
1ISP	LQD	*	N/A	15,851,574	0.90 %
1ISP	VLUE	*	N/A	14,366,477	0.81 %
1ISP	EWZ	*	N/A	14,110,829	0.80 %
1ISP	WCLD	*	N/A	12,834,317	0.73 %
1ISP	WTAI	N	N/A	12,589,514	0.71 %
1ISP	HERO	*	N/A	12,039,712	0.68 %
1ISP	EWC	*	N/A	11,664,842	0.66 %
1ISP	ICLN	*	N/A	11,201,937	0.63 %
1ISP	FIVG	*	N/A	11,047,602	0.63 %
1ISP	MCHI	*	N/A	10,214,513	0.58 %
1ISP	RING	*	N/A	8,652,920	0.49 %
1ISP	FINX	*	N/A	8,529,930	0.48 %
1ISP	VGK	*	N/A	7,899,634	0.45 %
1ISP	EWU	*	N/A	7,502,986	0.42 %
1ISP	FBT	*	N/A	7,011,156	0.40 %
1ISP	VOLT	N	N/A	6,291,836	0.36 %
1ISP	KWEB	*	N/A	3,193,485	0.18 %
	Udibonos	UDIS		42,189,709	2.39%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	42,189,709	2.39 %
	Reportos			20,700,509	1.17%
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	20,700,509	1.17 %
	TOTAL CARTERA			1,766,131,280	100.00%
	ACTIVO NETO			1,784,387,425	-
	VAR ESTABLECIDO \$			53,888,500	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			15,079,485	0.84%

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.