

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 Gob. Fed. Tasa fija			27,671,541	2.56%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	18,844,488	1.74 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	8,827,053	0.82 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			35,185,200	3.26%
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	35,185,200	3.26 %
	Chequera dolares			23,048	- %
CHD	40-002	9079977	N/A	23,048	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			433,608,819	40.15%
52	PEMERGE	FFR	N/A	213,629,269	19.78 %
52	PRINRVA	FFR	N/A	172,620,595	15.98 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	41,858,137	3.88 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	5,500,818	0.51 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			128,787,110	11.93%
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	39,885,346	3.69 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	37,116,455	3.44 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me)	35,887,683	3.32 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me)	11,554,498	1.07 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	4,343,127	0.40 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			421,735,687	39.05%
1ISP	VT	*	N/A	151,986,278	14.07 %
1ISP	IVV	*	N/A	107,382,139	9.94 %
1ISP	KWEB	*	N/A	46,257,992	4.28 %
1ISP	SHV	*	N/A	19,487,461	1.80 %
1ISP	GLD	*	N/A	18,365,354	1.70 %
1ISP	EZU	*	N/A	17,122,357	1.59 %
1ISP	VOO	*	N/A	12,291,988	1.14 %
1ISP	FBT	*	N/A	11,774,968	1.09 %
1ISP	VLUE	*	N/A	10,440,063	0.97 %
1ISP	ERUS	*	N/A	8,512,064	0.79 %
1ISP	GDX	*	N/A	6,196,090	0.57 %
1ISP	RING	*	N/A	6,101,595	0.57 %
1ISP	VGK	*	N/A	5,817,339	0.54 %
	Reportos			32,954,992	3.05%
IQ	BPAG91	200423	AAA(mex)	32,954,992	3.05 %
	TOTAL CARTERA			1,079,966,397	100.00%
	ACTIVO NETO			1,072,827,846	-
	VAR ESTABLECIDO \$			32,399,401	3.02%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			11,305,498	1.06%
	Cartera al:		26/Mzo/2020		-

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.