

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			19,134	- %
CHD	40-002	9079993	N/A	19,134	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			460,042,903	14.54%
52	PEMERGE	FFR	N/A	182,168,275	5.76 %
52	PRINRVA	FFR	N/A	167,499,464	5.29 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	82,980,739	2.62 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	27,394,425	0.87 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			2,287,054,395	72.29%
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me)	722,702,268	22.84 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	609,729,065	19.27 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me)	403,853,641	12.77 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	300,706,125	9.50 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	250,063,297	7.90 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			239,381,697	7.57%
11SP	IVV	*	N/A	78,886,342	2.49 %
11SP	MCHI	*	N/A	51,066,355	1.61 %
11SP	ACWI	*	N/A	38,400,028	1.21 %
11SP	EZU	*	N/A	28,467,534	0.90 %
11SP	EWJ	*	N/A	17,344,059	0.55 %
11SP	EEM	*	N/A	15,668,423	0.50 %
11SP	EWZ	*	N/A	9,548,956	0.30 %
	Reportos			177,263,987	5.60%
IQ	BPAG91	210826	AAA(mex)	127,639,469	4.03 %
IQ	BPAG91	190417	AAA(mex)	49,624,519	1.57 %
	TOTAL CARTERA			3,163,762,116	100.00%
	ACTIVO NETO			3,216,492,393	-
	VAR ESTABLECIDO \$			36,346,364	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			11,642,685	0.36%
	Cartera al:		1/31/2019		-

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.