

## PRINLS2

### PRINCIPAL SAM II, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE

#### DISCRECIONAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>58,093,018</b>	<b>4.71%</b>
M	BONOS	530731	AAA(mex)	42,161,107	3.42 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	15,931,911	1.29 %
	<b>CPOs sobre Acciones del IPC</b>			<b>42,903,880</b>	<b>3.48%</b>
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	31,395,400	2.55 %
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	11,508,480	0.93 %
	<b>Cetes</b>			<b>3,066,589</b>	<b>0.25%</b>
BI	CETES	250904	AAA(mex)	3,066,589	0.25 %
	<b>Chequera dolares</b>			<b>45,465</b>	<b>- %</b>
CHD	40-002	9079985	N/A	45,465	0.00 %
	<b>Soc. de Inv. de Renta Variable</b>			<b>187,532,175</b>	<b>15.20%</b>
52	GLREITS	FFX	N/A	73,476,861	5.96 %
52	PRINRVA	FFX	N/A	71,595,940	5.80 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	42,459,374	3.44 %
	<b>Sociedad de Inversion de Deuda</b>			<b>166,164,573</b>	<b>13.47%</b>
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	118,724,241	9.62 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	33,040,597	2.68 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	13,246,898	1.07 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me)	1,152,837	0.09 %
	<b>TRAC Tit. ref. acciones extr.</b>			<b>592,129,782</b>	<b>48.00%</b>
1ISP	VOO	*	N/A	165,145,809	13.39 %
1ISP	SHV	*	N/A	144,780,641	11.74 %
1ISP	IVV	*	N/A	98,879,404	8.02 %
1ISP	IJH	*	N/A	40,234,106	3.26 %
1ISP	CBU0	N	N/A	38,660,930	3.13 %
1ISP	VGK	*	N/A	36,475,077	2.96 %
1ISP	EWJ	*	N/A	35,308,283	2.86 %
1ISP	EDV	*	N/A	27,069,792	2.19 %
1ISP	MEXS	N	N/A	5,575,741	0.45 %
	<b>Udibonos</b>	<b>UDIS</b>		<b>71,374,363</b>	<b>5.79%</b>
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	28,733,667	2.33 %
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	16,629,287	1.35 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	14,328,677	1.16 %
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	11,682,733	0.95 %
	<b>Reportos</b>			<b>108,427,862</b>	<b>8.79%</b>
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	108,427,862	8.79 %
	<b>Varios</b>			<b>3,876,600</b>	<b>0.31%</b>
1I	IDTXX	N	Alta	3,876,600	0.31 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,233,614,307</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,225,535,990</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>23,162,630</b>	<b>1.89%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>10,961,636</b>	<b>0.91%</b>
	<b>Cartera al:</b>		8/30/2024		<b>-</b>

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