

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	%
	Chequera dolares			19,134	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	19,134	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			539,020,132	27.17%
52	PRINRVA	FFR	N/A	276,720,647	13.95 %
52	PEMERGE	FFR	N/A	200,821,611	10.12 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	37,532,865	1.89 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	23,945,008	1.21 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			851,337,647	42.91%
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me)	312,749,104	15.76 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	216,733,346	10.92 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me)	156,073,000	7.87 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	99,556,652	5.02 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	66,225,545	3.34 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			508,372,869	25.62%
11SP	IVV	*	N/A	242,836,717	12.24 %
11SP	SHV	*	N/A	99,432,781	5.01 %
11SP	EZU	*	N/A	57,217,349	2.88 %
11SP	ACWI	*	N/A	44,429,544	2.24 %
11SP	EUFN	*	N/A	17,087,578	0.86 %
11SP	IEV	*	N/A	16,282,688	0.82 %
11SP	EWJ	*	N/A	15,988,729	0.81 %
11SP	EWQ	*	N/A	6,665,274	0.34 %
11SP	DFJ	*	N/A	5,960,690	0.30 %
11SP	SX7EEX	N	N/A	2,471,519	0.12 %
	Reportos			85,297,218	4.30%
IQ	BPAG91	190417	AAA(mex)	85,297,218	4.30 %
	TOTAL CARTERA			1,984,046,998	100.00%
	ACTIVO NETO			1,999,865,970	-
	VAR ESTABLECIDO \$			37,797,467	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			15,409,742	0.77%
	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