

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	%
	CPOs sobre Acciones del IPC			15,471,500	0.48%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	15,471,500	0.48 %
	Chequera dolares			20,080	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	20,080	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			551,408,856	17.26%
52	PRINRVA	FFX	N/A	273,507,309	8.56 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	241,409,430	7.56 %
52	PRGLOB	FFX	N/A	28,317,313	0.89 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	8,174,805	0.26 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			1,208,256,366	37.83%
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me	300,012,878	9.39 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	273,939,590	8.58 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	203,373,725	6.37 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	191,294,119	5.99 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me	156,315,921	4.89 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	83,320,133	2.61 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			1,129,772,508	35.37%
1ISP	IVV	*	N/A	309,189,089	9.68 %
1ISP	EZU	*	N/A	168,173,449	5.27 %
1ISP	VT	*	N/A	156,190,685	4.89 %
1ISP	VOO	*	N/A	106,513,249	3.33 %
1ISP	VTV	*	N/A	44,973,068	1.41 %
1ISP	VDST	N	N/A	43,312,043	1.36 %
1ISP	EEM	*	N/A	38,307,861	1.20 %
1ISP	QQQ	*	N/A	26,703,418	0.84 %
1ISP	EWC	*	N/A	22,719,005	0.71 %
1ISP	JETS	*	N/A	22,011,050	0.69 %
1ISP	VLUE	*	N/A	20,054,998	0.63 %
1ISP	EWZ	*	N/A	15,934,199	0.50 %
1ISP	LQD	*	N/A	14,942,830	0.47 %
1ISP	RING	*	N/A	14,600,660	0.46 %
1ISP	MCHI	*	N/A	13,788,468	0.43 %
1ISP	FBT	*	N/A	13,616,379	0.43 %
1ISP	VGK	*	N/A	13,305,775	0.42 %
1ISP	EWU	*	N/A	11,931,372	0.37 %
1ISP	WCLD	*	N/A	9,419,394	0.29 %
1ISP	IEV	*	N/A	9,317,179	0.29 %
1ISP	WTAI	N	N/A	9,267,817	0.29 %
1ISP	HERO	*	N/A	8,964,674	0.28 %
1ISP	KWEB	*	N/A	8,911,420	0.28 %
1ISP	FIVG	*	N/A	8,532,764	0.27 %
1ISP	ICLN	*	N/A	8,432,563	0.26 %
1ISP	FINX	*	N/A	6,197,615	0.19 %
1ISP	VOLT	N	N/A	4,461,483	0.14 %
	Udibonos	UDIS		164,381,160	5.15%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	101,278,003	3.17 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	63,103,157	1.98 %
	Reportos			124,801,934	3.91%
IM	BPAG28	211111	AAA(mex)	124,801,934	3.91 %
	TOTAL CARTERA			3,194,112,404	100.00%
	ACTIVO NETO			3,204,209,771	-

VAR ESTABLECIDO \$

60,559,565 1.89%

VAR OBSERVADO PROMEDIO \$

21,412,188 0.68%

Cartera al:

8/31/2021

-

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