

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			19,127	- %
CHD	40-002	9079993	N/A	19,127	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			455,554,076	14.56%
52	PEMERGE	FFR	N/A	179,124,432	5.72 %
52	PRINRVA	FFR	N/A	165,992,303	5.30 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	82,857,608	2.65 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	27,579,734	0.88 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			2,293,418,838	73.29%
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me)	723,943,622	23.14 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	610,753,004	19.52 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me)	405,006,078	12.94 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	301,234,980	9.63 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	252,481,155	8.07 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			237,332,523	7.58%
11SP	IVV	*	N/A	78,938,793	2.52 %
11SP	MCHI	*	N/A	50,531,257	1.61 %
11SP	ACWI	*	N/A	38,236,467	1.22 %
11SP	EZU	*	N/A	28,167,596	0.90 %
11SP	EWJ	*	N/A	16,992,748	0.54 %
11SP	EEM	*	N/A	15,408,308	0.49 %
11SP	EWZ	*	N/A	9,057,354	0.29 %
	Reportos			142,778,150	4.56%
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	142,778,150	4.56 %
	TOTAL CARTERA			3,129,102,713	100.00%
	ACTIVO NETO			3,191,519,540	-
	VAR ESTABLECIDO \$			36,064,171	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			10,602,253	0.33%
	Cartera al:		7/Feb/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.