

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			19,127	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	19,127	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			533,393,035	27.52%
52	PRINRVA	FFR	N/A	274,230,712	14.15 %
52	PEMERGE	FFR	N/A	197,466,090	10.19 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	37,786,755	1.95 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	23,909,477	1.23 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			853,499,605	44.04%
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me)	313,286,299	16.17 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	217,097,314	11.20 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S6(me)	156,518,370	8.08 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me)	99,731,744	5.15 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	66,865,878	3.45 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			506,748,827	26.15%
11SP	IVV	*	N/A	242,998,176	12.54 %
11SP	SHV	*	N/A	99,243,583	5.12 %
11SP	EZU	*	N/A	56,614,498	2.92 %
11SP	ACWI	*	N/A	44,240,300	2.28 %
11SP	EUFN	*	N/A	16,882,265	0.87 %
11SP	IEV	*	N/A	16,202,426	0.84 %
11SP	EWJ	*	N/A	15,664,871	0.81 %
11SP	EWQ	*	N/A	6,603,663	0.34 %
11SP	DFJ	*	N/A	5,886,678	0.30 %
11SP	SX7EEX	N	N/A	2,412,366	0.12 %
	Reportos			44,358,289	2.29%
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	41,584,806	2.15 %
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	2,773,483	0.14 %
	TOTAL CARTERA			1,938,018,882	100.00%
	ACTIVO NETO			1,983,201,243	-
	VAR ESTABLECIDO \$			37,482,503	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			14,162,826	0.71%
	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