

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	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			50,207,736	4.21%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	34,317,601	2.88 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	8,233,156	0.69 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	7,656,980	0.64 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			43,641,378	3.66%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	23,100,000	1.94 %
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	20,541,378	1.72 %
	Cetes			130,741,986	10.96%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	121,367,518	10.18 %
BI	CETES	250918	AAA(mex)	9,374,468	0.79 %
	Chequera dolares			48,041	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	48,041	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			163,325,183	13.69%
52	PRINRVA	FFX	N/A	68,472,942	5.74 %
52	GLREITS	FFX	N/A	57,747,101	4.84 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	37,105,139	3.11 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			163,833,688	13.74%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	115,514,547	9.69 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	33,456,878	2.81 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	13,662,466	1.15 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me)	1,199,798	0.10 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			578,765,048	48.53%
1ISP	VOO	*	N/A	177,093,672	14.85 %
1ISP	IVV	*	N/A	85,169,002	7.14 %
1ISP	CBU7	N	N/A	83,877,387	7.03 %
1ISP	SHY	*	N/A	61,531,750	5.16 %
1ISP	IJH	*	N/A	44,244,067	3.71 %
1ISP	CBU0	N	N/A	40,953,795	3.43 %
1ISP	EWJ	*	N/A	34,135,694	2.86 %
1ISP	VGK	*	N/A	29,108,040	2.44 %
1ISP	SHV	*	N/A	11,422,552	0.96 %
1ISP	MEXS	N	N/A	5,687,518	0.48 %
1ISP	EDV	*	N/A	5,541,572	0.46 %
	Udibonos UDIS			34,889,574	2.93%
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	19,729,015	1.65 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	11,491,608	0.96 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	3,668,951	0.31 %
	Reportos			8,588,709	0.72%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	7,605,616	0.64 %
IS	BPA182	280928	AAA(mex)	983,093	0.08 %
	Varios			18,635,560	1.56%
1I	IDTXX	N	Alta	18,635,560	1.56 %
	TOTAL CARTERA			1,192,676,902	100.00%
	ACTIVO NETO			1,206,046,599	-
	VAR ESTABLECIDO \$			22,794,281	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			10,899,162	0.91%
	Cartera al:		1/16/2025		-

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