

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	%
	Acciones Ind.,Com. y de Serv.			97,702,292	7.49%
1	TRAXION	A	Alta	15,121,464	1.16 %
1	FEMSA	UBD	Alta	12,221,300	0.94 %
1	CEMEX	CPO	Alta	11,802,816	0.90 %
1	ALFA	A	Alta	9,725,320	0.75 %
1	VOLAR	A	Alta	9,504,000	0.73 %
1	GENTERA	*	Alta	8,842,500	0.68 %
1	KIMBER	A	Alta	7,874,471	0.60 %
1	ASUR	B	Alta	6,417,234	0.49 %
1	LAB	B	Alta	6,258,720	0.48 %
1	ALSEA	*	Alta	4,985,232	0.38 %
1	R	A	Alta	4,949,235	0.38 %
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			50,225,613	3.85%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	50,225,613	3.85 %
	Cert. Burs. Fiduc. Inmob.			3,624,250	0.28%
CF	FIBRAMQ	12	Alta	3,624,250	0.28 %
	Chequera dolares			39,152	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	39,152	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			209,539,602	16.05%
52	PRINRVA	FFX	N/A	138,719,596	10.63 %
52	GLREITS	FFX	N/A	40,643,901	3.11 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	30,176,105	2.31 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			279,961,077	21.45%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	208,055,785	15.94 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	40,756,309	3.12 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me	31,148,983	2.39 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			636,883,457	48.80%
1ISP	SHV	*	N/A	309,802,549	23.74 %
1ISP	VOO	*	N/A	178,827,693	13.70 %
1ISP	IVV	*	N/A	47,812,167	3.66 %
1ISP	VGK	*	N/A	42,009,845	3.22 %
1ISP	IJH	*	N/A	33,945,855	2.60 %
1ISP	EWJ	*	N/A	24,485,349	1.88 %
	Reportos			27,248,224	2.09%
BI	CETES	240125	AAA(mex)	27,248,224	2.09 %
	TOTAL CARTERA			1,305,223,666	100.00%
	ACTIVO NETO			1,298,276,751	-
	VAR ESTABLECIDO \$			24,537,431	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			10,578,000	0.77%
	Cartera al:		12/29/2023		-

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