

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			82,366,788	6.40%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	82,366,788	6.40 %
	Chequera dolares			39,714	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	39,714	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			227,061,590	17.63%
52	PRINRVA	FFX	N/A	145,225,174	11.28 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	42,281,628	3.28 %
52	GLREITS	FFX	N/A	39,554,788	3.07 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			216,882,736	16.84%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	179,639,805	13.95 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	29,983,176	2.33 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me	6,181,935	0.48 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	1,077,821	0.08 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			689,063,400	53.50%
1ISP	SHV	*	N/A	252,196,230	19.58 %
1ISP	VOO	*	N/A	186,257,280	14.46 %
1ISP	IVV	*	N/A	76,793,303	5.96 %
1ISP	CBU0	N	N/A	73,048,246	5.67 %
1ISP	IJH	*	N/A	34,200,260	2.66 %
1ISP	VGK	*	N/A	28,788,072	2.24 %
1ISP	EWJ	*	N/A	25,072,807	1.95 %
1ISP	EEM	*	N/A	12,707,201	0.99 %
	Udibonos	UDIS		30,222,733	2.35%
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	30,222,733	2.35 %
	Reportos			42,331,909	3.29%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	42,331,909	3.29 %
	TOTAL CARTERA			1,287,968,870	100.00%
	ACTIVO NETO			1,290,210,755	-
	VAR ESTABLECIDO \$			24,384,983	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			9,787,416	0.76%
	Cartera al:		1/25/2024		-

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