

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			45,732,342	3.76%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	23,647,000	1.94 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	14,174,879	1.17 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	7,910,463	0.65 %
	CPOs sobre Acciones del IPC			40,267,430	3.31%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	23,164,680	1.91 %
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	17,102,750	1.41 %
	Cetes			151,543,586	12.46%
BI	CETES	251113	AAA(mex)	126,689,771	10.42 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	15,607,588	1.28 %
BI	CETES	250918	AAA(mex)	9,246,227	0.76 %
	Chequera dolares			46,985	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	46,985	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			166,741,946	13.71%
52	PRINRVA	FFX	N/A	68,282,617	5.62 %
52	GLREITS	FFX	N/A	61,053,213	5.02 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	37,406,117	3.08 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			162,248,608	13.34%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	114,068,335	9.38 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	33,445,396	2.75 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	13,550,673	1.11 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me)	1,184,204	0.10 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			572,301,290	47.06%
1ISP	VOO	*	N/A	182,330,006	14.99 %
1ISP	IVV	*	N/A	88,333,617	7.26 %
1ISP	CBU7	N	N/A	82,659,907	6.80 %
1ISP	SHY	*	N/A	60,340,527	4.96 %
1ISP	IJH	*	N/A	45,280,297	3.72 %
1ISP	CBU0	N	N/A	37,204,818	3.06 %
1ISP	EWJ	*	N/A	35,332,230	2.91 %
1ISP	VGK	*	N/A	29,026,784	2.39 %
1ISP	EDV	*	N/A	6,086,702	0.50 %
1ISP	MEXS	N	N/A	5,706,402	0.47 %
	Udibonos UDIS			46,671,062	3.84%
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	31,484,179	2.59 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	11,543,062	0.95 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	3,643,821	0.30 %
	Reportos			14,100,926	1.16%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	14,100,926	1.16 %
	Varios			16,363,500	1.35%
1I	IDTXX	N	Alta	16,363,500	1.35 %
	TOTAL CARTERA			1,216,017,674	100.00%
	ACTIVO NETO			1,213,633,085	-
	VAR ESTABLECIDO \$			22,937,665	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			10,817,206	0.90%
	Cartera al:		11/29/2024		-

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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA