

## 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	%
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>44,798,265</b>	<b>3.75%</b>
M	BONOS	530731	AAA(mex)	23,044,583	1.93 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	14,155,562	1.18 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	7,598,120	0.64 %
	<b>CPOs sobre Acciones del IPC</b>			<b>39,766,700</b>	<b>3.33%</b>
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	23,007,600	1.93 %
1B	IVVPESO	ISHRS	Media	16,759,100	1.40 %
	<b>Cetes</b>			<b>145,472,166</b>	<b>12.17%</b>
BI	CETES	251113	AAA(mex)	120,472,407	10.08 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	15,693,740	1.31 %
BI	CETES	250918	AAA(mex)	9,306,019	0.78 %
	<b>Chequera dolares</b>			<b>46,840</b>	<b>- %</b>
CHD	40-002	9079985	N/A	46,840	0.00 %
	<b>Soc. de Inv. de Renta Variable</b>			<b>160,447,684</b>	<b>13.43%</b>
52	PRINRVA	FFX	N/A	67,886,435	5.68 %
52	GLREITS	FFX	N/A	55,763,802	4.67 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	36,797,447	3.08 %
	<b>Sociedad de Inversion de Deuda</b>			<b>162,499,521</b>	<b>13.60%</b>
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me)	114,616,433	9.59 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me)	33,130,596	2.77 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me)	13,561,926	1.14 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me)	1,190,566	0.10 %
	<b>TRAC Tit. ref. acciones extr.</b>			<b>572,299,395</b>	<b>47.90%</b>
1ISP	VOO	*	N/A	170,986,256	14.31 %
1ISP	IVV	*	N/A	85,406,961	7.15 %
1ISP	CBU7	N	N/A	81,615,888	6.83 %
1ISP	SHY	*	N/A	59,752,806	5.00 %
1ISP	IJH	*	N/A	41,490,747	3.47 %
1ISP	CBU0	N	N/A	39,951,258	3.34 %
1ISP	EWJ	*	N/A	33,555,508	2.81 %
1ISP	VGK	*	N/A	28,121,891	2.35 %
1ISP	SHV	*	N/A	20,297,381	1.70 %
1ISP	EDV	*	N/A	5,588,888	0.47 %
1ISP	MEXS	N	N/A	5,531,811	0.46 %
	<b>Udibonos</b>	<b>UDIS</b>		<b>44,904,727</b>	<b>3.76%</b>
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	29,912,196	2.50 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	11,394,215	0.95 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	3,598,316	0.30 %
	<b>Reportos</b>			<b>12,170,164</b>	<b>1.02%</b>
IS	BPA182	270121	AAA(mex)	12,170,164	1.02 %
	<b>Varios</b>			<b>12,477,150</b>	<b>1.04%</b>
1I	IDTXX	N	Alta	12,477,150	1.04 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,194,882,612</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,197,172,265</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>22,626,556</b>	<b>1.89%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>11,080,748</b>	<b>0.91%</b>
	<b>Cartera al:</b>		12/19/2024		<b>-</b>

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