

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			62,020,793	5.17%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	52,488,788	4.38 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	9,532,006	0.80 %
	Cetes			18,027,437	1.50%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	18,027,437	1.50 %
	Chequera dolares			39,521	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	39,521	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			182,479,578	15.22%
52	PRINRVA	FFX	N/A	78,708,571	6.57 %
52	GLREITS	FFX	N/A	59,668,734	4.98 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	44,102,273	3.68 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			145,434,738	12.13%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	113,780,904	9.49 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	29,767,469	2.48 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	1,110,054	0.09 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me	776,311	0.06 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			608,566,888	50.77%
1ISP	VOO	*	N/A	183,582,493	15.32 %
1ISP	SHV	*	N/A	138,891,544	11.59 %
1ISP	IVV	*	N/A	105,012,430	8.76 %
1ISP	IEI	*	N/A	38,741,764	3.23 %
1ISP	VGK	*	N/A	37,536,945	3.13 %
1ISP	IJH	*	N/A	35,317,300	2.95 %
1ISP	EWJ	*	N/A	31,798,507	2.65 %
1ISP	CBU0	N	N/A	24,036,892	2.01 %
1ISP	EEM	*	N/A	10,600,616	0.88 %
1ISP	INDA	*	N/A	3,048,399	0.25 %
	Udibonos	UDIS		27,827,346	2.32%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	27,827,346	2.32 %
	Reportos			154,205,904	12.87%
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	154,205,904	12.87 %
	TOTAL CARTERA			1,198,602,206	100.00%
	ACTIVO NETO			1,202,663,697	-
	VAR ESTABLECIDO \$			22,730,344	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,971,138	0.74%
	Cartera al:		4/30/2024		-

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