

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			61,956,567	5.08%
M	BONOS	330526	AAA(mex)	52,435,525	4.30 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	9,521,042	0.78 %
	Cetes			18,001,651	1.48%
BI	CETES	260219	AAA(mex)	18,001,651	1.48 %
	Chequera dolares			39,722	- %
CHD	40-002	9079985	N/A	39,722	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			183,589,013	15.06%
52	PRINRVA	FFX	N/A	79,357,023	6.51 %
52	GLREITS	FFX	N/A	60,153,124	4.93 %
52	PEMERGE	FFX	N/A	44,078,866	3.62 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			145,200,897	11.91%
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	113,584,966	9.32 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	29,732,864	2.44 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	1,108,042	0.09 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S3(me	775,025	0.06 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			622,089,883	51.02%
1ISP	VOO	*	N/A	184,972,756	15.17 %
1ISP	SHV	*	N/A	139,544,911	11.44 %
1ISP	IVV	*	N/A	105,833,380	8.68 %
1ISP	IEI	*	N/A	38,920,957	3.19 %
1ISP	VGK	*	N/A	37,882,417	3.11 %
1ISP	IJH	*	N/A	35,838,020	2.94 %
1ISP	EWJ	*	N/A	31,622,347	2.59 %
1ISP	CBU0	N	N/A	24,063,807	1.97 %
1ISP	EEM	*	N/A	10,578,962	0.87 %
1ISP	INDA	*	N/A	6,660,734	0.55 %
1ISP	EWY	*	N/A	6,171,592	0.51 %
	Udibonos			27,842,178	2.28%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	27,842,178	2.28 %
	Reportos			160,580,296	13.17%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	149,464,317	12.26 %
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	11,115,979	0.91 %
	TOTAL CARTERA			1,219,300,206	100.00%
	ACTIVO NETO			1,212,334,590	-
	VAR ESTABLECIDO \$			22,913,124	1.89%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,943,865	0.74%
	Cartera al:		4/25/2024		-

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