

## 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>61,282,771</b>	<b>1.96%</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	61,282,771	1.96 %
	<b>CPOs sobre Acciones del IPC</b>			<b>14,587,000</b>	<b>0.47%</b>
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	14,587,000	0.47 %
	<b>Chequera dolares</b>			<b>20,446</b>	<b>- %</b>
CHD	40-002	9079985	N/A	20,446	0.00 %
	<b>Soc. de Inv. de Renta Variable</b>			<b>596,018,115</b>	<b>19.09%</b>
52	PEMERGE	FFR	N/A	259,107,709	8.30 %
52	PRINRVA	FFR	N/A	257,439,233	8.25 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	50,933,010	1.63 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	28,538,163	0.91 %
	<b>Sociedad de Inversion de Deuda</b>			<b>1,147,072,501</b>	<b>36.75%</b>
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me	298,540,642	9.56 %
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	216,904,049	6.95 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	202,939,694	6.50 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	189,573,445	6.07 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me	154,982,105	4.96 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	84,132,567	2.70 %
	<b>TRAC Tit. ref. acciones extr.</b>			<b>1,014,467,252</b>	<b>32.50%</b>
1ISP	IVV	*	N/A	280,035,346	8.97 %
1ISP	EZU	*	N/A	169,243,629	5.42 %
1ISP	VOO	*	N/A	101,374,035	3.25 %
1ISP	VT	*	N/A	90,142,390	2.89 %
1ISP	EEM	*	N/A	65,651,891	2.10 %
1ISP	VTV	*	N/A	44,311,246	1.42 %
1ISP	VDST	N	N/A	44,103,948	1.41 %
1ISP	QQQ	*	N/A	24,712,271	0.79 %
1ISP	EWC	*	N/A	23,138,275	0.74 %
1ISP	VLUE	*	N/A	20,254,539	0.65 %
1ISP	EWZ	*	N/A	17,948,818	0.58 %
1ISP	MCHI	*	N/A	15,950,986	0.51 %
1ISP	LQD	*	N/A	15,027,851	0.48 %
1ISP	FBT	*	N/A	13,796,971	0.44 %
1ISP	VGK	*	N/A	13,407,852	0.43 %
1ISP	KWEB	*	N/A	12,059,983	0.39 %
1ISP	HERO	*	N/A	9,647,618	0.31 %
1ISP	IEV	*	N/A	9,357,056	0.30 %
1ISP	WTAI	N	N/A	9,013,900	0.29 %
1ISP	WCLD	*	N/A	8,584,677	0.28 %
1ISP	FIVG	*	N/A	8,433,769	0.27 %
1ISP	ICLN	*	N/A	8,387,153	0.27 %
1ISP	FINX	*	N/A	5,772,991	0.18 %
1ISP	VOLT	N	N/A	4,110,057	0.13 %
	<b>Udibonos</b>			<b>143,375,841</b>	<b>4.59%</b>
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	100,993,353	3.24 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	42,382,488	1.36 %
	<b>Reportos</b>			<b>144,875,298</b>	<b>4.64%</b>
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	144,875,298	4.64 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,121,699,223</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,997,688,397</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>56,656,311</b>	<b>1.89%</b>

**VAR OBSERVADO PROMEDIO \$****Cartera al:**

6/17/2021

**25,044,654****0.83%**

-

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