

## PEMERGE

### PRINCIPAL RV, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE

#### ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>CPOs sobre Acciones del IPC</b>			<b>9,506,700</b>	<b>1.14%</b>
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	9,506,700	1.14 %
	<b>TRAC Tit. ref. acciones extr.</b>			<b>820,745,724</b>	<b>98.03%</b>
1ISP	EEM	*	N/A	297,949,048	35.59 %
1ISP	MCHI	*	N/A	116,919,084	13.97 %
1ISP	EWT	*	N/A	82,846,434	9.90 %
1ISP	EWY	*	N/A	79,306,674	9.47 %
1ISP	KWEB	*	N/A	44,635,798	5.33 %
1ISP	EWZ	*	N/A	40,080,205	4.79 %
1ISP	FXI	*	N/A	39,266,033	4.69 %
1ISP	INDA	*	N/A	35,552,925	4.25 %
1ISP	ERUS	*	N/A	33,771,923	4.03 %
1ISP	EZA	*	N/A	17,181,090	2.05 %
1ISP	EIDO	*	N/A	15,914,920	1.90 %
1ISP	ECH	*	N/A	6,858,893	0.82 %
1ISP	EWB	*	N/A	4,187,647	0.50 %
1ISP	EPI	*	N/A	4,034,224	0.48 %
1ISP	TUR	*	N/A	2,240,827	0.27 %
	<b>Reportos</b>			<b>6,949,752</b>	<b>0.83%</b>
BI	CETES	211104	AAA(mex)	6,949,752	0.83 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>837,202,176</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>846,754,612</b>	<b>-</b>
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>43,607,863</b>	<b>5.15%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>18,476,659</b>	<b>2.20%</b>
	<b>Cartera al:</b>		6/17/2021		<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 28 DÍAS.