

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	%
	CPOs sobre Acciones del IPC			13,711,425	1.75%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	13,711,425	1.75 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			768,313,758	97.90%
1ISP	EEM	*	N/A	235,819,928	30.05 %
1ISP	MCHI	*	N/A	109,770,047	13.99 %
1ISP	EWT	*	N/A	87,804,169	11.19 %
1ISP	EWY	*	N/A	73,867,344	9.41 %
1ISP	KWEB	*	N/A	45,441,716	5.79 %
1ISP	EWZ	*	N/A	41,092,975	5.24 %
1ISP	INDA	*	N/A	38,535,053	4.91 %
1ISP	MFEM	*	N/A	38,322,558	4.88 %
1ISP	FXI	*	N/A	35,004,893	4.46 %
1ISP	ERUS	*	N/A	24,482,847	3.12 %
1ISP	EIDO	*	N/A	15,638,445	1.99 %
1ISP	EPI	*	N/A	8,207,024	1.05 %
1ISP	ECH	*	N/A	6,289,124	0.80 %
1ISP	EZA	*	N/A	4,085,586	0.52 %
1ISP	EWH	*	N/A	3,952,048	0.50 %
	Reportos			2,800,444	0.36%
BI	CETES	220210	AAA(mex)	2,800,444	0.36 %
	TOTAL CARTERA			784,825,627	100.00%
	ACTIVO NETO			784,446,913	-
	VAR ESTABLECIDO \$			40,399,016	5.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			16,088,397	2.03%
	Cartera al:		9/Sep/2021		-

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.