

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			10,434,640	1.75%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	10,434,640	1.75 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			577,979,470	96.87%
11SP	EEM	*	N/A	248,506,069	41.65 %
11SP	MCHI	*	N/A	102,743,137	17.22 %
11SP	EWY	*	N/A	49,892,056	8.36 %
11SP	EWT	*	N/A	44,664,084	7.49 %
11SP	EWZ	*	N/A	30,510,636	5.11 %
11SP	INDA	*	N/A	25,098,621	4.21 %
11SP	EZA	*	N/A	19,008,095	3.19 %
11SP	ERUS	*	N/A	17,968,629	3.01 %
11SP	FXI	*	N/A	16,341,289	2.74 %
11SP	EPI	*	N/A	9,763,721	1.64 %
11SP	TUR	*	N/A	5,156,723	0.86 %
11SP	KWEB	*	N/A	4,595,247	0.77 %
11SP	EWH	*	N/A	3,731,162	0.63 %
	Reportos			8,249,820	1.38%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	8,249,820	1.38 %
	TOTAL CARTERA			596,663,930	100.00%
	ACTIVO NETO			604,594,299	-
	VAR ESTABLECIDO \$			31,136,606	5.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			11,317,018	1.87%
	Cartera al:		5/31/2019		-

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.