

PRGLOB

PRINCIPAL HORIZONTE E, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE ESPECIALIZADO EN DEUDA ATRAVES DE TRAC'S

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			417,250,388	97.07%
1ISP	CBU7	N	N/A	113,174,271	26.33 %
1ISP	VDEA	N	N/A	103,898,201	24.17 %
1ISP	LQDA	N	N/A	71,775,175	16.70 %
1ISP	VDST	N	N/A	46,941,612	10.92 %
1ISP	IHYA	N	N/A	46,288,842	10.77 %
1ISP	SPSB	*	N/A	18,066,871	4.20 %
1ISP	FLOA	N	N/A	9,307,707	2.17 %
1ISP	TIP	*	N/A	7,797,709	1.81 %
	Reportos			12,603,160	2.93%
BI	CETES	211104	AAA(mex)	12,603,160	2.93 %
	TOTAL CARTERA			429,853,548	100.00%
	ACTIVO NETO			417,408,242	-
	VAR ESTABLECIDO \$			10,268,243	2.46%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,317,798	1.06%
	Cartera al:		6/17/2021		-

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.