

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.			385,871,879	98.66%
1ISP	CBU7	N	N/A	111,340,582	28.47 %
1ISP	VDEA	N	N/A	103,277,347	26.41 %
1ISP	LQDA	N	N/A	71,234,057	18.21 %
1ISP	IHYA	N	N/A	23,998,783	6.14 %
1ISP	STYC	N	N/A	21,384,346	5.47 %
1ISP	VDST	N	N/A	19,952,863	5.10 %
1ISP	SPSB	*	N/A	17,620,092	4.51 %
1ISP	FLOA	N	N/A	9,090,321	2.32 %
1ISP	TIPZ	*	N/A	7,973,487	2.04 %
	Reportos			5,245,145	1.34%
BI	CETES	220210	AAA(mex)	5,245,145	1.34 %
	TOTAL CARTERA			391,117,024	100.00%
	ACTIVO NETO			395,012,851	-
	VAR ESTABLECIDO \$			9,717,316	2.46%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			3,775,146	0.96%
	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.