

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.			214,844,111	99.53%
IISP	CBU3	N	N/A	65,239,538	30.22 %
IISP	CBU7	N	N/A	61,390,893	28.44 %
IISP	JPEA	N	N/A	45,910,801	21.27 %
IISP	LQDA	N	N/A	30,097,947	13.94 %
IISP	SPSB	*	N/A	9,351,211	4.33 %
IISP	IHYA	N	N/A	2,432,645	1.13 %
IISP	SHV	*	N/A	421,075	0.20 %
	Reportos			1,006,599	0.47%
LD	BONDESD	191226	AAA(mex)	1,006,599	0.47 %
	TOTAL CARTERA			215,850,710	100.00%
	ACTIVO NETO			217,659,158	-
	VAR ESTABLECIDO \$			5,354,415	2.46%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,401,649	1.10%
	Cartera al:		6/Jun/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.