

PRINRVA

PRINCIPAL RV AI, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE

ESPECIALIZADO EN ACCIONES

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Ind.,Com. y de Serv.			932,015,758	94.28%
1	AMX	L	Alta	123,355,844	12.48 %
1	GFNORTE	O	Alta	108,918,101	11.02 %
1	FEMSA	UBD	Alta	102,917,455	10.41 %
1	WALMEX	*	Alta	81,247,192	8.22 %
1	GMEXICO	B	Alta	54,610,677	5.52 %
1	CEMEX	CPO	Alta	46,647,225	4.72 %
1	AC	*	Alta	29,156,312	2.95 %
1	KIMBER	A	Alta	28,906,510	2.92 %
1	ALSEA	*	Alta	28,768,901	2.91 %
1	GAP	B	Alta	26,438,940	2.67 %
1	TLEVISA	CPO	Alta	24,881,399	2.52 %
1	ELEKTRA	*	Alta	24,605,641	2.49 %
1	GRUMA	B	Alta	24,363,756	2.46 %
1	OMA	B	Alta	22,993,212	2.33 %
1	GFINBUR	O	Alta	22,578,777	2.28 %
1	ALFA	A	Alta	20,887,618	2.11 %
1	PE&OLES	*	Alta	20,695,013	2.09 %
1	MEXCHEM	*	Alta	17,423,007	1.76 %
1	IENOVA	*	Alta	17,010,591	1.72 %
1	R	A	Alta	14,246,680	1.44 %
1	ASUR	B	Alta	13,904,864	1.41 %
1	LIVEPOL	C-1	Alta	13,904,320	1.41 %
1	BIMBO	A	Alta	13,501,416	1.37 %
1	PINFRA	*	Alta	12,774,309	1.29 %
1	GCARSO	A1	Alta	7,305,000	0.74 %
1	CHDRAUI	B	Media	7,296,560	0.74 %
1	HERDEZ	*	Media	6,229,859	0.63 %
1	MEGA	CPO	Alta	4,461,188	0.45 %
1	ALPEK	A	Alta	4,148,540	0.42 %
1	KOF	UBL	Alta	4,031,176	0.41 %
1	GENTERA	*	Alta	3,668,977	0.37 %
1	CUERVO	*	Alta	88,976	0.01 %
1	LALA	B	Alta	47,720	0.00 %
	Acciones Instit. de credito			10,446,800	1.06%
41	BBAJIO	O	Alta	10,446,800	1.06 %
	Cert. Burs. Fiduc. Inmob.			10,735,200	1.09%
CF	FUNO	11	Alta	10,735,200	1.09 %
	Reportos			35,344,015	3.58%
M	BONOS	210610	AAA(mex)	35,344,015	3.58 %
	TOTAL CARTERA			988,541,773	100.00%
	ACTIVO NETO			988,467,267	-
	VAR ESTABLECIDO \$			37,364,063	3.78%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			18,009,668	1.83%
	Cartera al:		6/20/2019		-

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 1 DÍA.