

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			4,361,578	2.22%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	4,361,578	2.22 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			171,797,051	87.28%
1ISP	INDA	*	N/A	36,482,936	18.54 %
1ISP	EWT	*	N/A	34,925,936	17.74 %
1ISP	MCHI	*	N/A	30,827,986	15.66 %
1ISP	EWY	*	N/A	23,069,448	11.72 %
1ISP	EPI	*	N/A	11,821,502	6.01 %
1ISP	EWZ	*	N/A	9,872,712	5.02 %
1ISP	FXI	*	N/A	9,545,472	4.85 %
1ISP	EEM	*	N/A	9,359,659	4.76 %
1ISP	EIDO	*	N/A	5,891,401	2.99 %
	Reportos			20,670,363	10.50%
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	20,670,363	10.50 %
	TOTAL CARTERA			196,828,993	100.00%
	ACTIVO NETO			196,553,613	-
	VAR ESTABLECIDO \$			10,122,511	5.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			3,545,980	1.81%
	Cartera al:		7/31/2024		-

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.