

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			4,281,466	2.23%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	4,281,466	2.23 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			170,250,825	88.75%
1ISP	INDA	*	N/A	36,073,775	18.80 %
1ISP	EWT	*	N/A	34,023,721	17.74 %
1ISP	MCHI	*	N/A	31,505,028	16.42 %
1ISP	EWY	*	N/A	21,692,855	11.31 %
1ISP	EPI	*	N/A	11,642,338	6.07 %
1ISP	EWZ	*	N/A	10,282,440	5.36 %
1ISP	FXI	*	N/A	9,645,763	5.03 %
1ISP	EEM	*	N/A	9,280,023	4.84 %
1ISP	EIDO	*	N/A	6,104,883	3.18 %
	Reportos			17,307,124	9.02%
IM	BPAG28	270805	AAA(mex)	17,307,124	9.02 %
	TOTAL CARTERA			191,839,415	100.00%
	ACTIVO NETO			187,399,367	-
	VAR ESTABLECIDO \$			9,651,067	5.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			3,098,129	1.62%
	Cartera al:		8/Ago/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.