

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			6,838,811	3.41%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	6,838,811	3.41 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			171,438,834	85.52%
1ISP	MCHI	*	N/A	37,513,555	18.71 %
1ISP	EWT	*	N/A	33,867,388	16.89 %
1ISP	EWY	*	N/A	28,806,176	14.37 %
1ISP	INDA	*	N/A	28,714,063	14.32 %
1ISP	EEM	*	N/A	10,155,804	5.07 %
1ISP	EWZ	*	N/A	10,066,593	5.02 %
1ISP	EPI	*	N/A	9,844,484	4.91 %
1ISP	FXI	*	N/A	8,736,384	4.36 %
1ISP	EIDO	*	N/A	3,734,387	1.86 %
	Reportos			22,182,994	11.07%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	22,182,994	11.07 %
	TOTAL CARTERA			200,460,639	100.00%
	ACTIVO NETO			200,202,856	-
	VAR ESTABLECIDO \$			10,310,447	5.15%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,803,397	1.44%
	Cartera al:		4/25/2024		-

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.