

PRINRVA

PRINCIPAL RV A1, 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.			996,752,844	97.68%
1	WALMEX	*	Alta	138,783,899	13.60 %
1	AMX	L	Alta	131,494,911	12.89 %
1	FEMSA	UBD	Alta	112,224,897	11.00 %
1	GMEXICO	B	Alta	100,776,548	9.88 %
1	GFNORTE	O	Alta	85,251,159	8.35 %
1	CEMEX	CPO	Alta	56,780,325	5.56 %
1	ASUR	B	Alta	34,629,388	3.39 %
1	R	A	Alta	29,555,599	2.90 %
1	AC	*	Alta	27,584,128	2.70 %
1	OMA	B	Alta	26,307,585	2.58 %
1	GAP	B	Alta	26,063,048	2.55 %
1	KIMBER	A	Alta	23,108,069	2.26 %
1	PINFRA	*	Alta	23,052,730	2.26 %
1	TLEVISA	CPO	Alta	18,896,455	1.85 %
1	GRUMA	B	Alta	18,104,523	1.77 %
1	KOF	UBL	Alta	17,911,343	1.76 %
1	ORBIA	*	Alta	15,994,885	1.57 %
1	ALSEA	*	Alta	15,141,674	1.48 %
1	IENOVA	*	Alta	13,694,855	1.34 %
1	PE&OLES	*	Alta	12,739,084	1.25 %
1	LIVEPOL	C-1	Alta	11,443,486	1.12 %
1	ELEKTRA	*	Alta	11,282,445	1.11 %
1	ALFA	A	Alta	10,884,688	1.07 %
1	BOLSA	A	Alta	9,938,860	0.97 %
1	SITES	B-1	Alta	7,301,000	0.72 %
1	GFINBUR	O	Alta	6,830,645	0.67 %
1	GCC	*	Alta	6,776,900	0.66 %
1	GCARSO	A1	Alta	2,462,910	0.24 %
1	BIMBO	A	Alta	1,718,794	0.17 %
1	ALPEK	A	Alta	7,906	0.00 %
1	HERDEZ	*	Media	5,413	0.00 %
1	GENTERA	*	Alta	4,692	0.00 %
	Acciones Instit. de credito			14,324,294	1.40%
41	BSMX	B	Alta	8,449,568	0.83 %
41	BBAJIO	O	Alta	5,874,726	0.58 %
	Reportos			9,378,739	0.92%
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	9,378,739	0.92 %
	TOTAL CARTERA			1,020,455,877	100.00%
	ACTIVO NETO			1,019,714,966	-
	VAR ESTABLECIDO \$			38,545,226	3.78%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			23,707,228	2.45%
	Cartera al:		11/19/2020		-

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.