

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
CERTIFICADOS BURSÁTILES				1,958,249	1.18%	
FIDUCIARIOS						
CF	FIBRAPL	14	Alta	622,974	0.38%	20,001
CF	FUNO	11	Alta	1,335,275	0.81%	35,054
INDUSTRIAL				29,716,011	17.97%	
1	ASUR	B	Alta	5,306,365	3.21%	138,131
1	GAP	B	Alta	5,863,688	3.55%	158,684
1	OMA	B	Alta	4,770,830	2.89%	139,649
1	ORBIA	*	Alta	3,563,503	2.16%	139,469
1	PINFRA	*	Alta	1,993,456	1.21%	52,893
1	VESTA	*	Alta	2,248,056	1.36%	54,240
1	VINTE	*	Media	5,970,113	3.61%	84,086
MATERIALES				42,490,750	25.70%	
1	CEMEX	CPO	Alta	13,113,651	7.93%	405,262
1	GCC	*	Alta	3,290,635	1.99%	89,489
1	GMEXICO	B	Alta	20,110,034	12.16%	673,424
1	PE&OLES	*	Alta	5,976,430	3.61%	294,975
NA				2,102,145	1.27%	
FF	FMX	23	Media	2,102,145	1.27%	51,292
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE				47,597,500	28.78%	
1	AC	*	Alta	7,622,898	4.61%	178,353
1	BIMBO	A	Alta	3,977,249	2.41%	117,766
1	FEMSA	UBD	Alta	15,667,697	9.48%	338,800
1	GRUMA	B	Alta	1,631,001	0.99%	37,395
1	KOF	UBL	Alta	4,291,103	2.60%	98,646
1	LACOMER	UBC	Alta	795,270	0.48%	20,974
1	SIGMAF	A	Alta	1,503,270	0.91%	15,058
1	WALMEX	*	Alta	12,109,012	7.32%	300,430
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				14,380,632	8.70%	
1	AMX	B	Alta	11,307,355	6.84%	264,328
1	MEGA	CPO	Alta	3,073,277	1.86%	100,091
SERVICIOS FINANCIEROS				21,630,433	13.08%	
1	GENTERA	*	Alta	3,015,309	1.82%	103,150
1	GFNORTE	O	Alta	16,487,744	9.97%	472,912
41	BBAJIO	O	Alta	2,127,380	1.29%	70,961
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				5,480,806	3.31%	
1	ALSEA	*	Alta	5,480,806	3.31%	167,306
TOTAL CARTERA				165,356,526	100.00%	2,367,604

Características del Cálculo del VaR

Metodología:	Histórico
Nivel de confianza:	95.00%
Tamaño de la muestra:	500 días
Horizonte temporal:	1 día
Promedio de VaR Mensual:	2,423,702
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.41%
Máximo % Autorizado:	3.00%

*La inversión en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios conlleva riesgos por el impacto que puede presentar la valuación por cambios en factores macroeconómicos como tasas de interés y tipo de cambio; así como factores que impacten los flujos de efectivo, decremento en ingresos, incremento en costos operativos que no puedan traspasarse a mayores precios, un mayor riesgo financiero por apalancamiento y riesgo de dilución, principalmente.