

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
CERTIFICADOS BURSÁTILES				1,870,905	1.14%	
FIDUCIARIOS						
CF	FIBRAPL	14	Alta	598,218	0.36%	19,346
CF	FUNO	11	Alta	1,272,687	0.78%	33,504
INDUSTRIAL				30,918,629	18.84%	
1	ASUR	B	Alta	5,895,138	3.59%	148,518
1	GAP	B	Alta	5,792,607	3.53%	155,784
1	OMA	B	Alta	5,176,535	3.15%	149,484
1	ORBIA	*	Alta	3,602,745	2.20%	151,122
1	PINFRA	*	Alta	2,044,610	1.25%	54,251
1	VESTA	*	Alta	2,124,114	1.29%	55,158
1	VINTE	*	Baja	6,282,880	3.83%	75,470
MATERIALES				40,332,490	24.58%	
1	CEMEX	CPO	Alta	12,302,134	7.50%	380,183
1	GCC	*	Alta	2,975,734	1.81%	80,926
1	GMEXICO	B	Alta	19,763,538	12.04%	633,732
1	PE&OLES	*	Alta	5,291,084	3.22%	275,807
NA				2,005,456	1.22%	
FF	FMX	23	Media	2,005,456	1.22%	48,131
PRODUCTOS DE CONSUMO				46,817,958	28.53%	
FRECUENTE						
1	AC	*	Alta	7,351,790	4.48%	174,234
1	BIMBO	A	Alta	3,934,807	2.40%	116,999
1	FEMSA	UBD	Alta	14,702,831	8.96%	319,592
1	GRUMA	B	Alta	1,730,671	1.05%	39,072
1	KOF	UBL	Alta	4,147,553	2.53%	95,346
1	LACOMER	UBC	Alta	827,883	0.50%	21,834
1	SIGMAF	A	Alta	1,592,312	0.97%	11,441
1	WALMEX	*	Alta	12,530,111	7.64%	323,385
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				13,933,342	8.49%	
1	AMX	B	Alta	10,869,409	6.62%	244,387
1	MEGA	CPO	Alta	3,063,933	1.87%	99,787
SERVICIOS FINANCIEROS				22,303,989	13.59%	
1	GENTERA	*	Alta	3,268,823	1.99%	109,049
1	GFNORTE	O	Alta	16,916,973	10.31%	485,224
41	BBAJO	O	Alta	2,118,193	1.29%	71,364
SERVICIOS PUBLICOS				870,743	0.53%	
1	ESENTIA	II	Media	870,743	0.53%	3,809
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				5,028,033	3.06%	
1	ALSEA	*	Alta	5,028,033	3.06%	156,069
TOTAL CARTERA				164,081,545	100.00%	2,308,128

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:	2,336,545
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 traslaparse a mayores precios, un mayor riesgo financiero por apalancamiento y riesgo de dilución, principalmente.