

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
<b>GUBERNAMENTAL</b>				<b>3,135,330</b>	<b>55.86%</b>	
BI	CETES	241010	AAA(mex)	2,830,939	50.44%	495
BI	CETES	241017	AAA(mex)	100,308	1.79%	20
M	BONOS	241205	AAA(mex)	204,083	3.64%	44
<b>INDUSTRIAL</b>				<b>5,565</b>	<b>0.10%</b>	
1	CADU	A	Baja	5,565	0.10%	195
<b>MATERIALES</b>				<b>82,731</b>	<b>1.47%</b>	
1	CEMEX	CPO	Alta	82,731	1.47%	2,768
<b>SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>				<b>150,547</b>	<b>2.68%</b>	
1	MEGA	CPO	Alta	119,270	2.13%	4,030
1ASP	DIS	*	N/A	31,277	0.56%	925
<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>				<b>1,776,271</b>	<b>31.65%</b>	
1ISP	EWZ	*	N/A	292,874	5.22%	7,247
1ISP	FLOT	*	N/A	404,979	7.22%	4,114
1ISP	IEFA	*	N/A	302,749	5.39%	4,313
1ISP	LRGF	*	N/A	325,337	5.80%	4,948
1ISP	SGOV	*	N/A	356,589	6.35%	3,496
1ISP	SHV	*	N/A	93,743	1.67%	980
<b>SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO</b>				<b>212,345</b>	<b>3.78%</b>	
1	AGUILAS	CPO	Media	2,472	0.04%	28
1	NEMAK	A	Media	209,873	3.74%	7,725
<b>TECNOLOGIA DE LA INFORMACION</b>				<b>249,819</b>	<b>4.45%</b>	
1ASP	BABA	N	N/A	94,609	1.69%	3,802
1ASP	BIDU	N	N/A	63,178	1.13%	2,646
1ASP	META	*	N/A	92,032	1.64%	3,478
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>5,612,608</b>	<b>100.00%</b>	<b>28,348</b>

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 Semanal:	28,340
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.50%
Máximo % Autorizado:	1.80%

\*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.