

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
CERTIFICADOS BURSÁTILES				2,154,704	1.20%	
FIDUCIARIOS						
CF	FIBRAPL	14	Alta	690,499	0.38%	22,046
CF	FUNO	11	Alta	1,464,205	0.81%	38,439
INDUSTRIAL				31,723,570	17.63%	
1	ASUR	B	Alta	5,671,271	3.15%	147,630
1	GAP	B	Alta	6,121,540	3.40%	165,662
1	OMA	B	Alta	5,021,558	2.79%	146,989
1	ORBIA	*	Alta	4,140,557	2.30%	162,053
1	PINFRA	*	Alta	2,256,798	1.25%	59,881
1	VESTA	*	Alta	2,355,404	1.31%	56,830
1	VINTE	*	Media	6,156,442	3.42%	86,710
MATERIALES				48,244,389	26.82%	
1	CEMEX	CPO	Alta	14,751,008	8.20%	467,631
1	GCC	*	Alta	3,530,309	1.96%	99,352
1	GMEXICO	B	Alta	22,652,434	12.59%	758,561
1	PE&OLES	*	Alta	7,310,638	4.06%	360,827
NA				1,988,070	1.11%	
FF	FMX	23	Media	1,988,070	1.11%	50,466
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE				51,124,024	28.42%	
1	AC	*	Alta	8,379,537	4.66%	196,056
1	BIMBO	A	Alta	4,253,218	2.36%	125,937
1	FEMSA	UBD	Alta	16,524,191	9.19%	357,321
1	GRUMA	B	Alta	1,727,222	0.96%	39,601
1	KOF	UBL	Alta	4,696,042	2.61%	107,955
1	LACOMER	UBC	Alta	834,808	0.46%	22,016
1	SIGMAF	A	Alta	1,573,619	0.87%	15,795
1	WALMEX	*	Alta	13,135,387	7.30%	325,895
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				15,215,711	8.46%	
1	AMX	B	Alta	11,963,760	6.65%	279,672
1	MEGA	CPO	Alta	3,251,951	1.81%	105,910
SERVICIOS FINANCIEROS				23,433,333	13.03%	
1	GENTERA	*	Alta	3,289,593	1.83%	112,532
1	GFNORTE	O	Alta	17,852,157	9.92%	512,047
41	BBAJIO	O	Alta	2,291,583	1.27%	76,438
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				6,006,308	3.34%	
1	ALSEA	*	Alta	6,006,308	3.34%	183,348
TOTAL CARTERA				179,890,109	100.00%	2,632,609

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:	2,604,677
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.43%
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.