

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	CERTIFICADOS BURSÁTILES			1,514,027	1.18%	
	FIDUCIARIOS					
CF	FIBRAPL	14	Alta	499,358	0.39%	16,032
CF	FUNO	11	Alta	1,014,669	0.79%	26,524
	INDUSTRIAL			25,006,983	19.49%	
1	ASUR	B	Alta	3,912,615	3.05%	98,291
1	GAP	B	Alta	4,165,657	3.25%	118,408
1	OMA	B	Alta	4,042,098	3.15%	118,318
1	ORBIA	*	Alta	2,891,318	2.25%	117,483
1	PINFRA	*	Alta	1,529,611	1.19%	40,473
1	VESTA	*	Alta	2,305,204	1.80%	55,618
1	VINTE	*	Media	6,160,480	4.80%	86,767
	MATERIALES			34,209,532	26.66%	
1	CEMEX	CPO	Alta	10,165,064	7.92%	323,782
1	GCC	*	Alta	2,521,920	1.97%	71,028
1	GMEXICO	B	Alta	16,694,687	13.01%	559,055
1	PE&OLES	*	Alta	4,827,861	3.76%	238,286
	NA			1,955,084	1.52%	
FF	FMX	23	Media	1,955,084	1.52%	50,991
	PRODUCTOS DE CONSUMO			34,514,613	26.90%	
	FRECUENTE					
1	AC	*	Alta	6,159,862	4.80%	144,122
1	BIMBO	A	Alta	2,958,319	2.31%	87,315
1	FEMSA	UBD	Alta	11,665,782	9.09%	252,262
1	GRUMA	B	Alta	1,181,712	0.92%	27,094
1	KOF	UBL	Alta	3,381,226	2.64%	77,729
1	LACOMER	UBC	Alta	569,969	0.44%	15,032
1	SIGMAF	A	Alta	1,144,121	0.89%	11,879
1	WALMEX	*	Alta	7,453,622	5.81%	192,368
	SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES			10,575,764	8.24%	
1	AMX	B	Alta	8,278,928	6.45%	193,533
1	MEGA	CPO	Alta	2,296,836	1.79%	73,348
	SERVICIOS FINANCIEROS			16,279,475	12.69%	
1	GENTERA	*	Alta	2,794,664	2.18%	96,425
1	GFNORTE	O	Alta	11,803,539	9.20%	333,418
41	BBAJIO	O	Alta	1,681,272	1.31%	56,081
	SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO			4,263,143	3.32%	
	BASICO					
1	ALSEA	*	Alta	4,263,143	3.32%	130,136
	TOTAL CARTERA			128,318,621	100.00%	1,837,604

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 Semanal:	1,817,565
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.38%
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.