

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS				1,924,640	1.15%	
CF	FIBRAPL	14	Alta	602,651	0.36%	19,489
CF	FUNO	11	Alta	1,321,989	0.79%	34,705
INDUSTRIAL				30,993,438	18.50%	
1	ASUR	B	Alta	6,043,490	3.61%	152,255
1	GAP	B	Alta	5,699,328	3.40%	153,275
1	OMA	B	Alta	5,095,129	3.04%	148,878
1	ORBIA	*	Alta	3,542,671	2.11%	148,602
1	PINFRA	*	Alta	2,079,673	1.24%	55,181
1	VESTA	*	Alta	2,153,139	1.29%	54,621
1	VINTE	*	Media	6,380,008	3.81%	76,637
MATERIALES				42,910,061	25.61%	
1	CEMEX	CPO	Alta	12,361,999	7.38%	382,033
1	GCC	*	Alta	3,003,988	1.79%	81,694
1	GMEXICO	B	Alta	20,892,177	12.47%	669,922
1	PE&OLES	*	Alta	6,651,897	3.97%	346,742
NA				1,902,082	1.14%	
FF	FMX	23	Media	1,902,082	1.14%	45,650
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE				47,209,297	28.17%	
1	AC	*	Alta	7,565,174	4.51%	177,002
1	BIMBO	A	Alta	3,774,403	2.25%	112,230
1	FEMSA	UBD	Alta	14,870,002	8.87%	323,226
1	GRUMA	B	Alta	1,617,715	0.97%	37,090
1	KOF	UBL	Alta	4,371,193	2.61%	100,487
1	LACOMER	UBC	Alta	818,745	0.49%	21,593
1	SIGMAF	A	Alta	1,588,754	0.95%	12,171
1	WALMEX	*	Alta	12,603,311	7.52%	325,274
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				14,274,518	8.52%	
1	AMX	B	Alta	11,241,583	6.71%	252,755
1	MEGA	CPO	Alta	3,032,935	1.81%	96,855
SERVICIOS FINANCIEROS				22,575,677	13.47%	
1	GENTERA	*	Alta	3,340,431	1.99%	112,562
1	GFNORTE	O	Alta	17,052,288	10.18%	489,105
41	BBAJIO	O	Alta	2,182,958	1.30%	73,546
SERVICIOS PUBLICOS				910,199	0.54%	
1	ESENTIA	II	Media	910,199	0.54%	4,240
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				4,858,549	2.90%	
1	ALSEA	*	Alta	4,858,549	2.90%	148,885
TOTAL CARTERA				167,558,461	100.00%	2,377,846

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:	2,368,117
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.