

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	INDUSTRIAL			5,763,792	15.06%	
1	ASUR	B	Alta	978,289	2.56%	25,466
1	GAP	B	Alta	2,167,415	5.66%	58,655
1	GCARSO	A1	Alta	329,133	0.86%	11,657
1	OMA	B	Alta	733,786	1.92%	21,479
1	ORBIA	*	Alta	233,600	0.61%	9,143
1	PINFRA	*	Alta	585,442	1.53%	15,534
1	VESTA	*	Alta	591,702	1.55%	14,276
1	VOLAR	A	Alta	144,425	0.38%	6,065
	MATERIALES			10,296,746	26.91%	
1	CEMEX	CPO	Alta	3,068,393	8.02%	94,825
1	GCC	*	Alta	304,693	0.80%	8,286
1	GMEXICO	B	Alta	4,999,205	13.07%	167,408
1	PE&OLES	*	Alta	1,924,455	5.03%	94,984
	PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE			11,047,267	28.87%	
1	AC	*	Alta	1,160,205	3.03%	27,145
1	BIMBO	A	Alta	810,861	2.12%	24,111
1	CHDRAUI	B	Alta	259,439	0.68%	6,345
1	FEMSA	UBD	Alta	2,913,612	7.61%	63,004
1	GRUMA	B	Alta	572,686	1.50%	13,130
1	KIMBER	A	Alta	596,043	1.56%	14,038
1	KOF	UBL	Alta	1,039,726	2.72%	23,902
1	LACOMER	UBC	Alta	181,148	0.47%	4,617
1	SIGMAF	A	Alta	645,811	1.69%	6,469
1	WALMEX	*	Alta	2,867,736	7.49%	71,150
	SALUD			148,500	0.39%	
1	LAB	B	Alta	148,500	0.39%	5,618
	SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES			3,888,262	10.16%	
1	AMX	B	Alta	3,381,334	8.84%	79,044
1	MEGA	CPO	Alta	346,079	0.90%	11,271
1	TLEVISA	CPO	Alta	160,849	0.42%	6,459
	SERVICIOS FINANCIEROS			6,668,099	17.43%	
1	BOLSA	A	Alta	220,364	0.58%	6,204
1	GENTERA	*	Alta	515,276	1.35%	17,627
1	GFINBUR	O	Alta	530,398	1.39%	16,083
1	GFNORTE	O	Alta	3,700,649	9.67%	106,144
1	Q	*	Alta	415,431	1.09%	16,412
1	R	A	Alta	233,192	0.61%	7,892
41	BBAJIO	O	Alta	437,352	1.14%	14,588
51	FMXRF	XFO	AAA/1	615,437	1.61%	172
	SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO			449,754	1.18%	
1	ALSEA	*	Alta	291,464	0.76%	8,897
1	LIVEPOL	C-1	Media	158,290	0.41%	3,525
	TOTAL CARTERA			38,262,420	100.00%	602,396

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:	606,942
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.58%
Máximo % Autorizado:	3.00%