

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	INDUSTRIAL			5,383,762	14.35%	
1	ASUR	B	Alta	929,467	2.48%	23,350
1	GAP	B	Alta	1,977,343	5.27%	56,205
1	GCARSO	A1	Alta	309,417	0.82%	10,871
1	OMA	B	Alta	656,532	1.75%	19,218
1	ORBIA	*	Alta	240,795	0.64%	9,784
1	PINFRA	*	Alta	561,864	1.50%	14,867
1	VESTA	*	Alta	560,807	1.49%	13,531
1	VOLAR	A	Alta	147,537	0.39%	6,481
	MATERIALES			10,815,732	28.82%	
1	CEMEX	CPO	Alta	3,110,907	8.29%	99,090
1	GCC	*	Alta	303,356	0.81%	8,544
1	GMEXICO	B	Alta	5,360,756	14.28%	179,515
1	PE&OLES	*	Alta	2,040,713	5.44%	100,722
	PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE			10,774,119	28.71%	
1	AC	*	Alta	1,201,809	3.20%	28,119
1	BIMBO	A	Alta	835,690	2.23%	24,665
1	CHDRAUI	B	Alta	254,133	0.68%	6,226
1	FEMSA	UBD	Alta	2,967,065	7.91%	64,160
1	GRUMA	B	Alta	543,306	1.45%	12,457
1	KIMBER	A	Alta	552,560	1.47%	13,013
1	KOF	UBL	Alta	1,057,004	2.82%	24,299
1	LACOMER	UBC	Alta	158,939	0.42%	4,192
1	SIGMAF	A	Alta	624,679	1.66%	6,486
1	WALMEX	*	Alta	2,578,934	6.87%	66,559
	SALUD			135,025	0.36%	
1	LAB	B	Alta	135,025	0.36%	5,108
	SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES			3,620,978	9.65%	
1	AMX	B	Alta	3,130,086	8.34%	73,171
1	MEGA	CPO	Alta	342,509	0.91%	10,938
1	TLEVISA	CPO	Alta	148,383	0.40%	5,959
	SERVICIOS FINANCIEROS			6,361,002	16.95%	
1	BOLSA	A	Alta	201,573	0.54%	5,675
1	GENTERA	*	Alta	468,041	1.25%	16,149
1	GFINBUR	O	Alta	517,958	1.38%	15,706
1	GFNORTE	O	Alta	3,431,384	9.14%	96,927
1	Q	*	Alta	402,169	1.07%	15,888
1	R	A	Alta	220,837	0.59%	7,474
41	BBAJIO	O	Alta	440,077	1.17%	14,679
51	FMXRF	XF0	AAA/1	678,963	1.81%	189
	SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO			438,677	1.17%	
1	ALSEA	*	Alta	290,129	0.77%	8,856
1	LIVEPOL	C-1	Media	148,548	0.40%	3,270
	TOTAL CARTERA			37,529,295	100.00%	601,246

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:	604,060
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.60%
Máximo % Autorizado:	3.00%