

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	INDUSTRIAL			5,363,978	14.35%	
1	ASUR	B	Alta	917,454	2.45%	23,048
1	GAP	B	Alta	1,951,770	5.22%	55,478
1	GCARSO	A1	Alta	320,489	0.86%	11,085
1	OMA	B	Alta	655,150	1.75%	19,177
1	ORBIA	*	Alta	251,283	0.67%	10,210
1	PINFRA	*	Alta	556,107	1.49%	14,714
1	VESTA	*	Alta	562,655	1.51%	13,575
1	VOLAR	A	Alta	149,070	0.40%	6,548
	MATERIALES			10,898,096	29.16%	
1	CEMEX	CPO	Alta	3,127,345	8.37%	99,614
1	GCC	*	Alta	303,399	0.81%	8,545
1	GMEXICO	B	Alta	5,363,996	14.35%	179,624
1	PE&OLES	*	Alta	2,103,356	5.63%	103,814
	PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE			10,746,303	28.75%	
1	AC	*	Alta	1,201,969	3.22%	28,122
1	BIMBO	A	Alta	848,195	2.27%	25,034
1	CHDRAUI	B	Alta	254,682	0.68%	6,239
1	FEMSA	UBD	Alta	2,921,955	7.82%	63,185
1	GRUMA	B	Alta	538,197	1.44%	12,339
1	KIMBER	A	Alta	554,726	1.48%	13,065
1	KOF	UBL	Alta	1,066,681	2.85%	24,521
1	LACOMER	UBC	Alta	160,362	0.43%	4,229
1	SIGMAF	A	Alta	623,552	1.67%	6,474
1	WALMEX	*	Alta	2,575,984	6.89%	66,483
	SALUD			138,403	0.37%	
1	LAB	B	Alta	138,403	0.37%	5,140
	SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES			3,544,912	9.48%	
1	AMX	B	Alta	3,071,397	8.22%	71,799
1	MEGA	CPO	Alta	330,951	0.89%	10,778
1	TLEVISA	CPO	Alta	142,564	0.38%	5,725
	SERVICIOS FINANCIEROS			6,248,971	16.72%	
1	BOLSA	A	Alta	199,187	0.53%	5,608
1	GENTERA	*	Alta	458,215	1.23%	15,810
1	GFINBUR	O	Alta	516,640	1.38%	15,666
1	GFNORTE	O	Alta	3,351,304	8.97%	94,665
1	Q	*	Alta	401,087	1.07%	15,845
1	R	A	Alta	211,517	0.57%	7,466
41	BBAJIO	O	Alta	431,690	1.15%	14,399
51	FMXRF	XF0	AAA/1	679,331	1.82%	
	SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO			438,118	1.17%	
1	ALSEA	*	Alta	290,293	0.78%	8,861
1	LIVEPOL	C-1	Media	147,825	0.40%	3,243
	TOTAL CARTERA			37,378,781	100.00%	596,400

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 Mensual:	598,380
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.58%
Máximo % Autorizado:	3.00%