

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN ACCIONES

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 28/06/2019

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Industriales					
1	CEMEX	CPO	ALTB	6,067,500.00	6.54%
1	FEMSA	UBD	ALTB	11,157,600.00	12.03%
1	GMEXICO	B	ALTB	10,685,044.98	11.52%
1	GMXT	*	ALTB	5,386,916.48	5.81%
1	GRUMA	B	ALTB	11,258,750.00	12.14%
				<u>44,555,811.46</u>	
				44,555,811.46	
Comerciales					
1	LIVEPOL	C-1	ALTB	5,343,500.00	5.76%
				<u>5,343,500.00</u>	
				5,343,500.00	
Servicios					
1	GFINBUR	O	ALTB	9,022,000.00	9.73%
1	GFNORTE	O	ALTB	6,681,600.00	7.20%
				<u>15,703,600.00</u>	
				15,703,600.00	
Comunicaciones y Transportes					
1	AMX	L	ALTB	11,874,500.00	12.80%
				<u>11,874,500.00</u>	
				11,874,500.00	
Reportos					
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	15,237,294.58	16.47%
				<u>15,237,294.58</u>	
				15,237,294.58	
CARTERA TOTAL:				92,714,706.04	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			4.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.2347 %		

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.