

**CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE NACIONAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 04/03/2021**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Industriales</b>					
1	CEMEX	CPO	ALTB	11,906,028.78	10.61%
1	FEMSA	UBD	ALTB	8,327,330.86	7.42%
1	GCC	*	ALTB	3,671,058.44	3.27%
1	GMEXICO	B	ALTB	7,715,100.95	6.87%
1	GRUMA	B	ALTB	2,662,707.96	2.37%
1	KOF	UBL	ALTB	3,230,686.20	2.87%
1	ORBIA	*	ALTB	4,741,052.82	4.22%
				42,253,966.01	
				42,253,966.01	
<b>Comerciales</b>					
1	WALMEX	*	ALTB	15,486,624.74	13.87%
				15,486,624.74	
				15,486,624.74	
<b>Servicios</b>					
1	GAP	B	ALTB	5,944,897.40	5.29%
1	GFNORTE	O	ALTB	11,755,950.00	10.47%
1	OMA	B	ALTB	5,848,429.74	5.21%
				23,549,277.14	
				23,549,277.14	
<b>Otros</b>					
1	AC	*	ALTB	4,450,942.47	3.96%
1	ALFA	A	ALTB	4,493,000.25	4.00%
				8,943,942.72	
				8,943,942.72	
<b>Comunicaciones y Transportes</b>					
1	AMX	L	ALTB	14,844,790.08	13.23%
1	MEGA	CPO	ALTB	3,222,581.49	2.87%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	2,099,984.28	1.87%
				20,167,355.85	
				20,167,355.85	

**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 ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

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

**CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE NACIONAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 04/03/2021**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Reportos</b>					
LD	BONDESD	240425	mxAAA	1,801,655.72	1.60%
				1,801,655.72	
				1,801,655.72	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>112,202,822.18</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>4.000 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>1.8103 %</b>		

**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 ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

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