

**CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE NACIONAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 11/08/2022**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Industriales</b>					
1	ASUR	B	ALTB	2,069,419.66	2.06%
1	BIMBO	A	ALTB	2,485,666.08	2.48%
1	CEMEX	CPO	ALTB	6,161,286.39	6.15%
1	CUERVO	*	ALTB	787,198.50	0.78%
1	FEMSA	UBD	ALTB	8,972,200.48	8.96%
1	GCC	*	ALTB	2,104,182.00	2.10%
1	GMEXICO	B	ALTB	8,934,753.45	8.92%
1	GRUMA	B	ALTB	1,245,829.20	1.24%
1	KIMBER	A	ALTB	898,783.14	0.89%
1	KOF	UBL	ALTB	2,264,350.20	2.26%
1	ORBIA	*	ALTB	3,289,156.00	3.28%
1	PINFRA	*	ALTB	800,205.28	0.79%
1	VESTA	*	ALTB	1,046,824.02	1.04%
				41,059,854.40	
				41,059,854.40	
<b>Comerciales</b>					
1	ALSEA	*	ALTB	525,217.19	0.52%
1	LAB	B	ALTB	1,249,535.04	1.24%
1	WALMEX	*	ALTB	9,978,432.03	9.97%
				11,753,184.26	
				11,753,184.26	
<b>Servicios</b>					
1	BOLSA	A	ALTB	530,887.50	0.53%
1	GAP	B	ALTB	6,122,814.99	6.11%
1	GFNORTE	O	ALTB	11,018,031.68	11.00%
1	OMA	B	ALTB	1,128,023.40	1.12%
1	Q	*	ALTB	481,288.98	0.48%
1	R	A	ALTB	1,074,083.67	1.07%
				20,355,130.22	
				20,355,130.22	
<b>Otros</b>					
1	AC	*	ALTB	2,696,492.37	2.69%
1	ALFA	A	ALTB	2,989,578.24	2.98%

**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: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE NACIONAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 11/08/2022**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Otros</b>					
1	GCARSO	A1	ALTB	854,418.60	0.85%
				<u>6,540,489.21</u>	
				<u>6,540,489.21</u>	
<b>Comunicaciones y Transportes</b>					
1	AMX	L	ALTB	14,158,613.23	14.30%
1	MEGA	CPO	ALTB	375,875.10	0.37%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	3,711,193.20	3.70%
				<u>18,245,681.53</u>	
				<u>18,245,681.53</u>	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	2,128,353.63	2.12%
				<u>2,128,353.63</u>	
				<u>2,128,353.63</u>	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>100,082,693.25</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>4.000 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>1.7435 %</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.