

**CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE NACIONAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 31/12/2021**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Industriales</b>					
1	ASUR	B	ALTB	2,236,823.16	1.75%
1	BIMBO	A	ALTB	2,272,650.27	1.78%
1	CEMEX	CPO	ALTB	10,055,676.24	7.89%
1	CUERVO	*	ALTB	800,496.96	0.62%
1	FEMSA	UBD	ALTB	10,024,255.08	7.87%
1	GCC	*	ALTB	3,258,999.60	2.56%
1	GMEXICO	B	ALTB	7,377,139.80	5.79%
1	GRUMA	B	ALTB	4,535,033.00	3.56%
1	KIMBER	A	ALTB	1,346,733.29	1.05%
1	KOF	UBL	ALTB	1,621,772.30	1.27%
1	ORBIA	*	ALTB	4,925,193.02	3.86%
1	PINFRA	*	ALTB	1,004,640.00	0.78%
1	VESTA	*	ALTB	847,812.49	0.66%
				50,307,225.21	
				50,307,225.21	
<b>Comerciales</b>					
1	ALSEA	*	ALTB	457,828.80	0.35%
1	WALMEX	*	ALTB	16,772,518.70	13.17%
				17,230,347.50	
				17,230,347.50	
<b>Servicios</b>					
1	BOLSA	A	ALTB	549,628.24	0.43%
1	GAP	B	ALTB	6,951,011.60	5.46%
1	GFNORTE	O	ALTB	12,896,555.04	10.13%
1	OMA	B	ALTB	4,185,666.89	3.28%
1	Q	*	ALTB	607,652.61	0.47%
				25,190,514.38	
				25,190,514.38	

**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 31/12/2021**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Otros</b>					
1	AC	*	ALTB	4,810,314.60	3.77%
1	ALFA	A	ALTB	3,878,194.04	3.04%
1	GCARSO	A1	ALTB	810,033.22	0.63%
				9,498,541.86	
				9,498,541.86	
<b>Comunicaciones y Transportes</b>					
1	AMX	L	ALTB	18,353,253.78	14.56%
1	MEGA	CPO	ALTB	625,189.12	0.49%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	3,331,992.15	2.61%
				22,310,435.05	
				22,310,435.05	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	2,764,242.69	2.17%
				2,764,242.69	
				2,764,242.69	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>127,301,306.69</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>4.000 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>1.4995 %</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.