

**CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 18/02/2021**

| TIPO DE VALOR                       | EMISORA | SERIE  | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO    | %              |
|-------------------------------------|---------|--------|-----------------------------|----------------------|----------------|
| <b>Industriales</b>                 |         |        |                             |                      |                |
| 1                                   | ACCELSA | B      | MINB                        | 9,532,638.35         | 29.38%         |
|                                     |         |        |                             | 9,532,638.35         |                |
|                                     |         |        |                             | 9,532,638.35         |                |
| <b>Comerciales</b>                  |         |        |                             |                      |                |
| 1                                   | GFAMSA  | A      | BAJB                        | 817,097.01           | 2.51%          |
| 1                                   | SORIANA | B      | MEDB                        | 2,348,355.54         | 7.23%          |
|                                     |         |        |                             | 3,165,452.55         |                |
|                                     |         |        |                             | 3,165,452.55         |                |
| <b>Servicios</b>                    |         |        |                             |                      |                |
| 1                                   | GAP     | B      | ALTB                        | 4,212,400.00         | 12.97%         |
|                                     |         |        |                             | 4,212,400.00         |                |
| 1B                                  | NAFTRAC | ISHRS  | ALTB                        | 8,611,615.50         | 26.51%         |
|                                     |         |        |                             | 8,611,615.50         |                |
|                                     |         |        |                             | 12,824,015.50        |                |
| <b>Comunicaciones y Transportes</b> |         |        |                             |                      |                |
| 1                                   | AMX     | L      | ALTB                        | 945,090.18           | 2.90%          |
|                                     |         |        |                             | 945,090.18           |                |
|                                     |         |        |                             | 945,090.18           |                |
| <b>Reportos</b>                     |         |        |                             |                      |                |
| IM                                  | BPAG28  | 230209 | mxAAA                       | 6,010,664.53         | 18.50%         |
|                                     |         |        |                             | 6,010,664.53         |                |
|                                     |         |        |                             | 6,010,664.53         |                |
| <b>CARTERA TOTAL:</b>               |         |        |                             | <b>32,477,861.11</b> | <b>100.00%</b> |
| <b>VaR ESTABLECIDO:</b>             |         |        | <b>4.500 %</b>              |                      |                |
| <b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>      |         |        | <b>1.2166 %</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, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

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