

**CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE NACIONAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 29/07/2022**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Industriales</b>					
1	ASUR	B	ALTB	1,854,336.00	1.86%
1	BIMBO	A	ALTB	2,346,270.76	2.36%
1	CEMEX	CPO	ALTB	5,615,435.99	5.65%
1	CUERVO	*	ALTB	815,293.80	0.82%
1	FEMSA	UBD	ALTB	8,919,538.48	8.98%
1	GCC	*	ALTB	2,101,513.20	2.11%
1	GMEXICO	B	ALTB	8,619,283.40	8.68%
1	GRUMA	B	ALTB	1,352,369.15	1.36%
1	KIMBER	A	ALTB	967,424.52	0.97%
1	KOF	UBL	ALTB	2,253,032.10	2.26%
1	ORBIA	*	ALTB	3,439,080.32	3.46%
1	PINFRA	*	ALTB	806,955.52	0.81%
1	VESTA	*	ALTB	1,079,352.45	1.08%
				40,169,885.69	
				40,169,885.69	
<b>Comerciales</b>					
1	ALSEA	*	ALTB	537,274.02	0.54%
1	LAB	B	ALTB	1,395,326.40	1.40%
1	WALMEX	*	ALTB	10,271,956.24	10.34%
				12,204,556.66	
				12,204,556.66	
<b>Servicios</b>					
1	BOLSA	A	ALTB	537,116.58	0.54%
1	GAP	B	ALTB	5,707,936.40	5.74%
1	GFNORTE	O	ALTB	10,530,500.12	10.60%
1	OMA	B	ALTB	1,018,814.85	1.02%
1	Q	*	ALTB	457,110.28	0.46%
1	R	A	ALTB	1,099,556.01	1.10%
				19,351,034.24	
				19,351,034.24	
<b>Otros</b>					
1	AC	*	ALTB	2,740,744.89	2.76%
1	ALFA	A	ALTB	2,974,715.28	2.99%

**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 29/07/2022**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Otros</b>					
1	GCARSO	A1	ALTB	851,313.57	0.85%
				6,566,773.74	
				6,566,773.74	
<b>Comunicaciones y Transportes</b>					
1	AMX	L	ALTB	14,254,130.60	14.48%
1	MEGA	CPO	ALTB	388,240.49	0.39%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	4,061,210.40	4.09%
				18,703,581.49	
				18,703,581.49	
<b>Reportos</b>					
IM	BPAG28	241107	mxAAA	2,283,525.79	2.30%
				2,283,525.79	
				2,283,525.79	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>99,279,357.61</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>4.000 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>1.8045 %</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.