

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE NACIONAL
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 29/01/2021

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Industriales					
1	CEMEX	CPO	ALTB	9,780,345.12	9.48%
1	FEMSA	UBD	ALTB	7,774,025.60	7.53%
1	GCC	*	ALTB	3,575,203.46	3.46%
1	GMEXICO	B	ALTB	2,340,848.16	2.27%
1	GRUMA	B	ALTB	2,586,614.58	2.50%
1	KOF	UBL	ALTB	3,032,883.36	2.94%
1	ORBIA	*	ALTB	4,210,442.36	4.08%
1	PE&OLES	*	ALTB	1,328,534.25	1.28%
				34,628,896.89	
				34,628,896.89	
Comerciales					
1	WALMEX	*	ALTB	14,294,699.70	13.86%
				14,294,699.70	
				14,294,699.70	
Servicios					
1	GAP	B	ALTB	5,561,465.40	5.39%
1	GFNORTE	O	ALTB	11,087,889.05	10.75%
1	OMA	B	ALTB	5,469,715.92	5.30%
				22,119,070.37	
				22,119,070.37	
Otros					
1	AC	*	ALTB	4,243,247.44	4.11%
1	ALFA	A	ALTB	4,999,730.40	4.84%
				9,242,977.84	
				9,242,977.84	
Comunicaciones y Transportes					
1	AMX	L	ALTB	14,839,687.22	14.48%
1	MEGA	CPO	ALTB	3,260,538.80	3.16%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	2,080,823.55	2.01%
				20,181,049.57	
				20,181,049.57	

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.

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE NACIONAL
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 29/01/2021

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Reportos					
IM	BPAG28	210812	mxAAA	1,646,205.37	1.59%
				1,646,205.37	
LD	BONDES	250220	mxAAA	1,000,474.05	0.97%
				1,000,474.05	
				2,646,679.42	
CARTERA TOTAL:				103,113,373.79	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			4.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.9735 %		

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.