

SOCIEDAD DE INVERSION DE RENTA VARIABLE

ESPECIALIZADA EN ACCIONES " INDIZADA AL INDICE DE PRECIOS Y COTIZACIONES DE LA BOLSA MEXICANA DE VALORES SA DE CV"

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Accs. no suscept. nego. en			11	0.00%
00	ABACOGF	A	NULB	11	0.00%
	ACCIONES:			400,005,611	87.07%
1	GMEXICO	B	ALTB	28,717,017	6.25%
1	CEMEX	CPO	ALTB	18,875,913	4.11%
1	PE&OLES	*	ALTB	9,911,029	2.16%
1	MFRISCO	A-1	ALTB	6,377,455	1.39%
1	MEXCHEM	*	ALTB	5,793,156	1.26%
1	ICH	B	ALTB	1,480,309	0.32%
1	ALFA	A	ALTB	16,964,160	3.69%
1	GCARSO	A1	ALTB	5,708,175	1.24%
1	URBI	*	ALTB	3,734,332	0.81%
1	GEO	B	ALTB	3,445,572	0.75%
1	ICA	*	ALTB	3,374,875	0.74%
1	GAP	B	ALTB	3,174,444	0.69%
1	HOMEX	*	ALTB	2,498,620	0.54%
1	INCARSO	B-1	ALTB	1,657,500	0.36%
1	ASUR	B	ALTB	1,381,821	0.30%
1	ARA	*	ALTB	1,233,252	0.27%
1	ELEKTRA	*	ALTB	7,038,958	1.53%
1	WALMEX	V	ALTB	47,822,844	10.41%
1	FEMSA	UBD	ALTB	29,037,960	6.32%
1	BIMBO	A	ALTB	8,859,520	1.93%
1	GMODELO	C	ALTB	8,421,660	1.83%
1	KIMBER	A	ALTB	7,251,214	1.58%
1	SORIANA	B	ALTB	1,802,834	0.39%
1	COMERCI	UBC	ALTB	1,408,914	0.31%
1	ARCA	*	ALTB	1,440,146	0.31%
1	CHDRAUI	B	ALTB	1,357,650	0.30%
1	GRUMA	B	ALTB	714,550	0.16%
1	LAB	B	ALTB	2,776,305	0.60%
1	GFNORTE	O	ALTB	16,295,367	3.55%
1	GFINBUR	O	ALTB	11,386,003	2.48%
1	COMPARC	*	ALTB	5,099,125	1.11%
1	BOLSA	A	ALTB	1,338,120	0.29%
1	AMX	L	ALTB	95,984,108	20.89%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	24,237,872	5.28%
1	TELMEX	L	ALTB	9,856,753	2.15%
1	AZTECA	CPO	ALTB	2,376,402	0.52%
1	AXTEL	CPO	ALTB	1,171,676	0.26%
	CPOs S/ ACCS. DEL IPC			58,846,936	12.81%
1B	NAFTRAC	02	ALTB	58,846,936	12.81%
	PAGARE BANCARIO			546,611	0.12%
I	NAFIN	11181	AAA	546,611	0.12%
	TOTAL CARTERA			459,399,168	100.00%
	ACTIVO NETO			458,346,975	
	VAR ESTABLECIDO %				24.50%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO %				7.55%

EN EL CALCULO DEL VaR SE UTILIZO EL METODO PARAMETRICO CON UN NIVEL DE CONFIANZA DEL 95%, UNA MUESTRA DE UN AÑO DE OBSERVACIONES Y UN HORIZONTE DE TIEMPO DE ACUERDO A LA CLASIFICACION DEL FONDO

Cartera al:

29/Abr/2011