

INVEXDX
CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2019
CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
IM	BPAG28	200514	mxAAA	20,075,723.60	2.67%
				20,075,723.60	
LD	BONDES	190808	mxAAA	50,206,228.00	6.70%
LD	BONDES	191226	mxAAA	50,201,890.50	6.69%
LD	BONDES	200924	mxAAA	60,309,969.00	8.04%
				160,718,087.50	
				180,793,811.10	
Bancarios					
I	BACMEXT	19264	mxA-1+	80,467,807.45	10.73%
I	BACMEXT	19274	mxA-1+	80,338,706.00	10.72%
I	BACMEXT	19284	mxA-1+	70,179,350.96	9.36%
I	BACMEXT	19294	mxA-1+	80,073,642.37	10.68%
				311,059,506.78	
				311,059,506.78	
Reportos					
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	57,354,699.53	7.65%
				57,354,699.53	
LD	BONDES	240425	mxAAA	200,137,431.80	26.76%
				200,137,431.80	
				257,492,131.33	
CARTERA TOTAL:				749,345,449.21	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.050 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0017 %		

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.