

**CLASIFICACION: CORTO PLAZO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 11/08/2022**  
**CALIFICACION: AAAf/S2(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
BI	CETES	220818	mxA-1+	9,986,251.00	3.43%
BI	CETES	220825	mxA-1+	24,923,222.50	8.57%
BI	CETES	220901	mxA-1+	19,907,130.00	6.84%
BI	CETES	221013	mxA-1+	29,556,777.00	10.16%
BI	CETES	221103	mxA-1+	9,799,912.00	3.37%
BI	CETES	230601	mxA-1+	37,125,032.00	12.76%
				<hr/>	
				131,298,324.50	
IM	BPAG28	240509	mxAAA	19,976,479.00	6.87%
				<hr/>	
				19,976,479.00	
LD	BONDESD	231005	mxAAA	19,981,566.60	6.87%
LD	BONDESD	250814	mxAAA	29,992,243.80	10.31%
				<hr/>	
				49,973,810.40	
LF	BONDESF	230202	mxAAA	40,178,533.20	13.87%
LF	BONDESF	230525	mxAAA	20,085,576.80	6.90%
				<hr/>	
				60,264,110.00	
				<hr/>	
				261,512,723.90	
<b>Reportos</b>					
BI	CETES	230504	mxA-1+	10,002,173.86	3.44%
				<hr/>	
				10,002,173.86	
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	19,243,206.33	6.61%
				<hr/>	
				19,243,206.33	
				<hr/>	
				29,245,380.19	
				<hr/>	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>290,758,104.09</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>0.050 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.0146 %</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.