

CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/02/2021
CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LD	BONDES	210520	mxAAA	30,072,101.10	6.99%
LD	BONDES	220113	mxAAA	29,999,307.90	6.97%
LD	BONDES	220317	mxAAA	29,969,167.50	6.96%
LD	BONDES	231005	mxAAA	49,922,155.00	11.60%
LD	BONDES	250814	mxAAA	29,812,301.40	6.93%
				169,775,032.90	
				169,775,032.90	
Bancarios					
I	BACMEX	21094	mxA-1+	60,104,082.58	13.97%
I	BACMEX	21104	mxA-1+	40,035,111.85	9.30%
I	BACMEX	21114	mxA-1+	50,002,960.02	11.62%
				150,142,154.45	
				150,142,154.45	
Reportos					
IM	BPAG28	230209	mxAAA	80,166,584.29	18.69%
				80,166,584.29	
LD	BONDES	240425	mxAAA	30,003,290.83	6.97%
				30,003,290.83	
				110,169,875.12	
CARTERA TOTAL:				430,087,062.47	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.050 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0023 %		

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.