

CLASIFICACION: CORTO PLAZO INDIZADA O COBERTURA DOLARES

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 26/02/2021

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|--------------------------------|----------|--------|-----------------------------|-------------------------|----------------|
| Inversión en Dólares | | | | | |
| CHD | EFFECTIV | | | 1,253,356,965.21 | 99.71% |
| | | | | 1,253,356,965.21 | |
| | | | | 1,253,356,965.21 | |
| Reportos | | | | | |
| IQ | BPAG91 | 211223 | mxAAA | 3,671,604.78 | 0.29% |
| | | | | 3,671,604.78 | |
| | | | | 3,671,604.78 | |
| CARTERA TOTAL: | | | | 1,257,028,569.99 | 100.00% |
| VaR ESTABLECIDO: | | | 2.000 % | | |
| VaR OBSERVADO PROMEDIO: | | | 1.2757 % | | |

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.